

Central Daily Market Report

2019年4月16日(火)
セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位：億円	2019年4月16日		2019年4月17日		2019年4月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,300		▲ 2,000		▲ 1,000	
財政	800		▲ 7,400		3,000	
資金過不足	▲ 500		▲ 9,400		2,000	
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出						
全店共通						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証券買入			2,500			
国債買入						
CP等買入				▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 200	900		200		
当預増減	200		▲ 6,900		2,000	
当座預金残高	3,969,800		3,962,900		3,964,900	
準備預金残高	3,461,300					
積み終了先	2,183,700		4月17日以降の残り所要積立額		積数 546,000	
超過準備	942,400		1日平均		18,800	
非準備預金先	508,500					
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額					3,065,000	
準備預金進捗率	実績	82.19%	日数	3.33%		

●2019年4月16日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担ONは、邦銀を中心に▲0.086~▲0.025%での調達で始まった。新しい積み期間に入り、月末には10連休が控えているものの、取り急ぐ動きは見られず、出合い一巡後は閑散とした状況となった。ターム物に関しては、10連休を跨ぐ期間の物で数件の出合いが見られた。

<レポ市場>

GCT/N(4/17-4/18)は、▲0.130~▲0.105%程度での出合い。SCはロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。10Y334~354、5Y130~139、30Y59~62などにビッドの出入りが見立った。

<短国市場>

現先レート(T/N)は、小幅上昇。アウトライト市場では、短国買入オペが2,500億円(前回比▲5,000億円)でオファーされた。平均落札利回較差+0.011%、按分落札利回較差+0.008%と、足元ファンディングレートの上昇や、大型連休を控えていることから、引け値の低い銘柄の在庫調整の売りから小甘い結果となった。マーケットでは、3M物が▲0.190~▲0.185%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は小売業態で大型案件が見られたことをはじめ、鉄鋼やノンバンク等複数業態で比較的多くまとまった額の調達が散見され、発行総額は2,200億円程度と償還総額の1,300億円程度を上回った。発行レートについては、概ね横ばい圏で推移している。

●短期金融市場関連指標

2019/4/16	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	単位：%	最低	最高	平均	最低	最高			平均	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.065				-	▲ 0.118	▲ 0.025	0.010	22,221.66	52.55	111.94-95	111.89-90
T/N							-	▲ 0.121						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.230	▲ 0.042				-	▲ 0.124						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.142						
3W	▲ 0.035	0.000	▲ 0.017				-	▲ 0.144						
1M	▲ 0.075	▲ 0.020	▲ 0.043				-	▲ 0.136						
3M							▲ 0.189	▲ 0.139						
6M							▲ 0.196	▲ 0.155						
1Y							▲ 0.190	▲ 0.158						
									日付	4/9	4/10	4/11	4/12	4/15
									日銀当預残	3,899,100	3,880,500	3,885,300	3,883,000	3,969,600
									準備預金残	3,442,700	3,417,100	3,422,800	3,396,600	3,465,500
									マネタリーベース	5,021,100	5,002,700	5,009,000	5,008,000	5,095,600
									無担O/N加重平均	▲0.064%	▲0.064%	▲0.063%	▲0.062%	▲0.061%
									コール市場残高	100,141	103,188	102,015	93,993	84,708
									うち無担	75,878	80,593	79,058	74,835	69,839
									うちO/N	46,368	50,718	49,163	44,985	40,889
									うち有担	24,263	22,595	22,957	19,158	14,869

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額(億円)	募入額(億円)	募入最低額	募入最高利回・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非価格競争入札(億円)
20年利付国債	168	0.40%	9,000	2019/4/17	2039/3/20	37,125.0	7,277.00	100.6000	0.3670%	47.1709%	100.6300	0.3660%	1,713.0

●オペ結果

種類	オファー額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率	応札総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	按分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均落札レート・利回較差・価格較差	按分比率
国庫短期証券買入	2,500	2019/4/17			8,348	2,501	0.008		0.011	29.2
社債等買入	750	2019/4/22			1,759	750	0.026		0.037	87.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	30,000	2019/4/16	2019/4/17		15	15		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2019/4/16	2019/4/17		200	200		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2019/4/18	2019/4/25	2.91	0	0				

●2019年4月17日の予定

*3月の貿易統計	*米国ページブック *米国2月の貿易収支 *米国2月の卸売売上高 *英国3月の消費者物価指数	*交付税特別会計借入 (10,500億円、4/26借入)
----------	---------------------------------------------------------	---------------------------------

◆本資料は信頼できると思われる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

◆本資料は何かの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。

◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録見書をよくお読みください。

セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入