Central Daily Market Report

2019年4月17日（水）
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17日 需給速報		2019年4月18日 需給予想		2019年4月19日 当社予想	
銀行券	▲ 2,200		▲ 3,700		▲ 1,000	
財政	▲ 6,400		7,400		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 8,600		3,700		▲ 4,000	
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						
国庫短期証買入	2,500					
国債買入			5,700			
CP等買入		▲ 200		▲ 100		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援					1,300	▲ 1,300
社債等買入						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給		200				
当預増減	▲ 6,100		9,300		▲ 4,000	

当座預金残高	3,963,700	3,973,000	3,969,000
準備預金残高	3,450,300		
積み終了先	3,360,900		
超過準備	3,013,500		
非準備預金先	513,400		

4月18日以降の残り所要積立額	
積数	109,200
1日平均	3,900

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	96.44%	日数 6.67%

●2019年4月17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。昨日に引続き調達ニーズは限定的で、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、目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GCT/N(4/18-4/19)は、▲0.105～▲0.095%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目立った。

<短国市場>

現先レート(T/N)は、小幅上昇。アウトライト市場は、週内に2回の入札を控え動意なく閑散で、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は鉄鋼や小売、卸売等の業態で大ロットの調達が散見され、償還総額1,300億円程度に対し、発行総額は2,900億円程度まで膨らんだ。発行レートについては、引続き0%近辺の狭いレンジで決着している。

●短期金融市場関連指標

2019/4/17	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.065				－	▲ 0.105
T/N							－	▲ 0.104
S/N							－	－
1W							－	▲ 0.111
2W			▲ 0.045				－	▲ 0.129
3W	▲ 0.055	▲ 0.020	▲ 0.023				－	▲ 0.131
1M			▲ 0.040				－	▲ 0.127
3M			0.000				▲ 0.187	▲ 0.134
6M							▲ 0.193	▲ 0.154
1Y							▲ 0.180	▲ 0.158

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
▲ 0.013	0.012	22,277.97	56.31	111.98-00	112.01-02

日付	4/10	4/11	4/12	4/15	4/16
日銀当預残	3,880,500	3,885,300	3,883,000	3,969,600	3,969,800
準備預金残	3,417,100	3,422,800	3,396,600	3,465,500	3,461,300
マネタリーベース	5,002,700	5,009,000	5,008,000	5,095,600	5,097,200
無担O/N加重平均	▲0.064%	▲0.063%	▲0.062%	▲0.061%	▲0.065%
コール市場残高	103,188	102,015	93,993	84,708	86,144
うち無担	80,593	79,058	74,835	69,839	64,896
うちO/N	50,718	49,163	44,985	40,889	34,326
うち有担	22,595	22,957	19,158	14,869	21,248

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
交付税特会	－	－	10,500	2019/4/26	2019/10/25	290,978.0	10,500.08		0.0000%	3.6086%		0.0000%	

●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
国債買入（残存期間1年以下）	500	2019/4/18			3,338	500		0.015	0.015	
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,800	2019/4/18			11,725	4,807	0.007		0.007	86.1
国債買入（物価連動債）	250	2019/4/18			1,169	252	▲0.160		▲0.214	49.0
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	27,459	2019/4/17	2019/4/18		20	20		▲0.600	▲0.600	

種類		スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額（億円）
被災地金融支援オペ	第96回	2019/4/19	2020/4/17	0	1,068
被災地金融支援オペ(熊本)	第35回	2019/4/19	2020/4/17	0	200

●2019年4月18日の予定

*月例経済報告
*米国2月の企業在庫
*米国3月の小売売上高
*国庫短期証券(827回)入札
（1年、19,000億円、4/22発行）
*流動性供給入札
（6,000億円、4/19発行）

◆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。
◆本資料は何ら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論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