

Central Daily Market Report

2019年4月18日(木)
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18日		2019年4月19日		2019年4月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 3,900		▲ 3,800		▲ 3,000	
財政	8,700		6,500		1,000	
資金過不足	4,800		2,700		▲ 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						▲ 5,100
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	5,700					
CP等買入		▲ 100		▲ 200		
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				▲ 100	800	
E T F 買入			400			
国債補充供給						
当預増減	10,400		2,800		▲ 6,300	
当座預金残高	3,974,100		3,976,900		3,970,600	
準備預金残高	3,462,500					
積み終了先	3,426,500		4月19日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,402,200		積数		48,800	
非準備預金先	511,600		1日平均		1,800	
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	98.41%	日数	10.00%		

●2019年4月18日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担ONは、地銀・信託・証券業態から▲0.086~▲0.03%での調達で始まった。昨日に比べ業態に拡がりは見られたものの、弱い地合いに変わりはなかった。一巡後は▲0.086%で少額の出合いが見られた程度であった。ターム物に関しては、特段の出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GCT/N(4/19-4/22)は、▲0.115~▲0.100%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、横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、1Y物の入札が実施された。WI取引において▲0.170~▲0.167%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1691%、按分落札利回▲0.1651%と、マーケットの慎重姿勢を反映してか、前回債からレートが上昇する結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、新発1Y物が▲0.185~▲0.176%出合いと堅調に推移した。この他に、3M物が▲0.185~▲0.180%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場について、発行総額は1,400億円程度となったものの、1,000億円弱の大型発行の期落ちがあったこともあり、償還総額1,600億円程度を下回った。発行レートは発行頻度、発行残高が少ない一部の銘柄でレート低下余地を探る動きが見られた。

●短期金融市場関連指標

2019/4/18	無担(速報)			有担(速報)			短国		東京レポレート		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	売買参考算計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)		
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.069				-	▲ 0.097		▲ 0.030	▲ 0.017	22,090.12	▲ 187.85	112.03-04	111.84-85		
T/N			▲ 0.086				-	▲ 0.105									
S/N							-	-									
1W	▲ 0.070	▲ 0.035	▲ 0.055				-	▲ 0.111									
2W							-	▲ 0.130									
3W			▲ 0.015				-	▲ 0.130									
1M	▲ 0.045	▲ 0.040	▲ 0.044				-	▲ 0.128									
3M								▲ 0.185	▲ 0.134								
6M								▲ 0.193	▲ 0.154								
1Y								▲ 0.176	▲ 0.158								
												日付	4/11	4/12	4/15	4/16	4/17
												日銀当預残	3,885,300	3,883,000	3,969,600	3,969,800	3,963,700
												準備預金残	3,422,800	3,396,600	3,465,500	3,461,300	3,450,300
												マネタリーベース	5,009,000	5,008,000	5,095,600	5,097,200	5,093,200
												無担O/N加重平均	▲ 0.063%	▲ 0.062%	▲ 0.061%	▲ 0.065%	▲ 0.065%
												コール市場残高	102,015	93,993	84,708	86,144	89,042
												うち無担	79,058	74,835	69,839	64,896	63,684
												うちO/N	49,163	44,985	40,889	34,326	32,964
												うち有担	22,957	19,158	14,869	21,248	25,358

●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第I非償債競争入札(億円)
国庫短期証券	827	-	19,000	2019/4/22	2020/4/20	72,451.0	15,371.6	100.1650	▲0.1651%	39.4366%	100.1690	▲0.1691%	3,628.0
流動性供給	284	-	6,000	2019/4/19		21,133.0	5,971.0		▲0.0100%	18.9189%		▲0.0110%	

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	74,875	2019/4/18	2019/4/19		7	7		▲0.600	▲0.600	

●2019年4月19日の予定

*2月の石油等消費動態統計	*米国3月の住宅着工件数	*国庫短期証券(828回)入札
*3月の全国消費者物価指数(GPI)	*EURO、London祝日(Good Friday)	(3ヶ月、43,000億円、4/22発行)
市場予想：前月同月比(除く生鮮)+0.7%		*交付税特別会計借入
		(10,500億円、5/7借入)

◆本資料は信頼できるとさ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。