

Central Daily Market Report

2019年4月1日(月)
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1日 需給速報	2019年4月2日 需給予想	2019年4月3日 当社予想	
銀行券	700	500	1,000	
財政	▲ 27,100	▲ 20,400	▲ 12,000	
資金過不足	▲ 26,400	▲ 19,900	▲ 11,000	
金融調節	スタート	エンド	スタート	
貸出				
全店共通	1,800	▲ 1,600		
国債買現				
国債売現				
国庫短期証買入				
国債買入	7,600			
CP等買入				
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	▲ 300	1,900	300	
当預増減	▲ 17,000	▲ 19,600	▲ 11,000	
当座預金残高	3,923,300	3,903,700	3,892,700	
準備預金残高	3,426,700			
積み終了先	3,426,400			
超過準備	3,426,400			
非準備預金先	496,600			
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額			3,127,000	
準備預金進捗率	実績	99.93%	日数	54.84%

●2019年4月1日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、年度末要因が剥落したものの、調達意欲は限定的で、朝方は地銀・信託・証券業態を中心に▲0.086~▲0.015%の出会い。一巡後は閑散で、▲0.08%出会いが散見される程度であった。ターム物は期が明けたことで、1~2W物を中心に出会いが見られた。

<レポ市場>

GCT/N(4/2-4/3)は、▲0.09~▲0.08%程度での出会い。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。10Y334~353、5Y130~138、30Y59~61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。アウトライト市場は、動意なく閑散で、特段の出会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。CP発行市場は、卸売・鉄鋼業態で大型案件がみられ、償還総額800億円程度に対して、発行総額は1,800億円程度となり、発行超となった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2019/4/1	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	▲ 0.067				-	▲ 0.089	▲ 0.085	0.010	21,509.03	303.22	110.98-99	111.04-05
T/N							-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.015	▲ 0.033				-	▲ 0.086						
2W	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.035				-	▲ 0.092						
3W	▲ 0.020	0.000	▲ 0.013				-	▲ 0.105						
1M							-	▲ 0.129						
3M							▲ 0.170	▲ 0.139						
6M							▲ 0.160	▲ 0.155						
1Y							▲ 0.182	▲ 0.157						
									日付	3/25	3/26	3/27	3/28	3/29
									日銀当預残	3,905,600	3,920,200	3,914,900	3,939,100	3,940,300
									準備預金残	3,411,100	3,430,800	3,425,100	3,444,900	3,462,500
									マネタリーベース	5,027,500	5,042,500	5,037,700	5,063,000	5,064,400
									無担O/N加重平均	▲0.062%	▲0.064%	▲0.066%	▲0.067%	▲0.060%
									コール市場残高	102,837	102,083	101,818	101,142	51,166
									うち無担	88,873	89,570	89,588	85,566	41,283
									うちO/N	58,158	65,800	64,758	61,361	28,623
									うち有担	13,964	12,513	12,230	15,576	9,883

●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	業分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	55,175	2019/4/1	2019/4/2		306	306		▲0.600	▲0.600	

●2019年4月2日の予定

*3月実績/4月見込み財政資金対民間収支 *3月のマネタリーベース	*米国2月の耐久財新規受注	*10年利付国債入札 (21,000億円、4/3発行)
--------------------------------------	---------------	--------------------------------

◆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