

# Central Daily Market Report

2019年4月12日(金)

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12日		2019年4月15日		2019年4月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,300		▲ 700		0	
財政	▲ 9,600		74,900		1,000	
資金過不足	▲ 10,900		74,200		1,000	
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			1,900	▲ 1,800		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	7,500					
国債買入			10,400			
CP等買入	1,500	▲ 300		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援社債等買入		▲ 100				
E T F 買入	100		400			
国債補完供給	▲ 100			100		
当預増減	▲ 2,300		85,100		1,000	
当座預金残高	3,883,000		3,968,100		3,969,100	
準備預金残高	3,397,800					
積み終了先	3,397,700				4月15日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,397,700				積数	
非準備預金先	485,200				1日平均	
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額					3,133,000	
準備預金進捗率	実績		100.00%		日数	
					96.77%	

## ●2019年4月12日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末要因によるレート上昇は見られず、朝方は都銀・信託・地銀・証券業態より▲0.08~▲0.02%の調達で始まった。一巡後は閑散で、▲0.08%近辺の出合いが散見された程度であった。ターム物は月内物を中心に出会いが見られた。

### <レポ市場>

GCT/N(4/15-4/16)は、▲0.150~▲0.130%程度での出会い。SCはローラーオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。10Y334~354、5Y130~138、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、低下した。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.205%で出合う展開となる中、平均落札利回▲0.1984%、按分落札利回▲0.1861%と前回債からレートが低下する結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットは特段の出合いもなく閑散で、新発3M物が▲0.187%で出合って引けた。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、案件数は膨らまなかったものの、ノンバンク業態1社で1,000億円程度の大型案件が実施され、発行総額は1,500億円程度と償還総額の600億円程度を上回った。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

2019/4/12	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.062				-	▲ 0.130	▲ 0.055	0.010	21,870.56	159.18	111.65-66	111.85-86
T/N							-	▲ 0.137						
S/N							-	-						
1W			0.001				-	▲ 0.137						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.148						
3W							-	▲ 0.149						
1M	▲ 0.045	▲ 0.005	▲ 0.037				-	▲ 0.146						
3M							▲ 0.190	▲ 0.145						
6M							▲ 0.197	▲ 0.154						
1Y							▲ 0.190	▲ 0.158						
									日付	4/5	4/8	4/9	4/10	4/11
									日銀当預残	3,896,000	3,896,700	3,899,100	3,880,500	3,885,300
									準備預金残	3,420,800	3,424,800	3,442,700	3,417,100	3,422,800
									マネタリーベース	5,018,600	5,018,700	5,021,100	5,002,700	5,009,000
									無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.063%	▲0.064%	▲0.064%	▲0.063%
									コール市場残高	104,605	100,643	100,141	103,188	102,015
									うち無担	79,939	74,558	75,878	80,593	79,058
									うちO/N	52,104	45,913	46,368	50,718	49,163
									うち有担	24,666	26,085	24,263	22,595	22,957

## ●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)
国庫短期証券	826	-	43,000	2019/4/15	2019/7/22	111,163.0	34,882.6	100.0500	▲0.1861%	3.5119%	100.0533	▲0.1984%	8,117.0
エネルギー対策	-	-	8,500	2019/4/22	2020/4/20	165,728.0	8,499.89		0.0000%	5.1289%		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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	15,000	2019/4/15	2019/4/26		1,884	1,884				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2019/4/15			9,511	3,507	0.001		0.002	75.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,000	2019/4/15			7,536	4,005	0.000		0.001	75.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,800	2019/4/15			4,848	1,811	0.007		0.008	72.6
国債買入(残存期間25年超)	500	2019/4/15			2,175	504	0.005		0.007	70.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	23,113	2019/4/12	2019/4/15		59	59		▲0.600	▲0.600	

## ●2019年4月15日の予定

特にありません。

◆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