

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年3月5日(木)

短期市場の推移

	2月28日	3月2日	3月3日	3月4日
加重平均金利	▲0.025	▲0.023	▲0.024	▲0.032
東京レポレート(ON)	▲0.075	▲0.073	▲0.083	▲0.107
無コール残	104,106	119,463	117,109	114,514
ON	75,283	86,845	73,761	81,616
その他	28,823	32,618	43,348	32,898
有コール残	21,829	18,739	18,356	22,655

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表
※加重平均金利は無担保コールONのもの。無・有コール残は無担保・有担保コール残高の意。

3月6日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 マネタリーベースと日本銀行の取引(2月)	-	22:30 (米)1月貿易収支	-488億米ドル
8:50 貿易収支(2月上中旬)	-	22:30 (米)2月非農業部門雇用者数	19.5万人
15:00 コール市場残高(2月)	-	22:30 (米)2月失業率	3.5%

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の短期市場金利

	無担保コール(速報)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.075	0.001	▲0.042	▲0.101
T/N	▲0.040	▲0.010	▲0.030	▲0.150
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.000	▲0.144
2W	-	-	-	▲0.144
3W	-	-	-	▲0.149
1M	-	-	-	▲0.158
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.161
6M	-	-	-	▲0.174
1Y	-	-	-	▲0.184

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.04%の出合から始まり、その後は主に▲0.070~▲0.010%の水準で出合が見られた。一部業態の調達意欲が減退し同加重平均金利(速報)は、前営業日対比▲0.01%の▲0.042%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.060	▲0.070 ~ ▲0.050	▲0.070 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

調達サイドの動向に大きな変化はなく、出合の水準は本日と横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	3月5日	3月6日	3月9日
券	▲500	+0	+1,000
財政	+3,300	+900	▲2,000
過不足	+2,800	+900	▲1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+8,300	-	-
CP等買入	▲100	▲500	+4,000
社債等買入	▲100	▲100	-
ETF買入	-	+400	-
国債補完供給	+400	+500	-
当座預金増減	+10,800	+1,200	+3,000
当座預金残高	3,910,100	3,911,300	3,914,300
準備預金残高	3,396,600	主な需給要因	
積み終了先	3,396,400	国債発行(30年)	
超過準備	3,396,400	国庫短期証券発行・償還(3M)	
非準備預金残高	513,500	-	
準備預金進捗率	99.9%	-	
平均	65.5%	-	
乖離率	34.4%	-	

3月5日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債補完供給(3/5~3/6)	462	462	▲0.350	▲0.350		
	54	54	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース(億円)
3月4日時点 5,039,800

所要
今積期の所要準備額 3,026,800
3月6日以降の残り所要積数 2,100
平均 200

国庫短期証券入札予定

3月6日	3ヶ月	第892回
3月9日	6ヶ月	第893回
3月13日	3ヶ月	
3月17日	1年	
3月10日	5年	
3月12日	20年	
3月26日	40年	
3月31日	2年	

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオファー金額	直近オファー額	オファー予定日	直近日	残り回数
1年以下	100~1,000 程度	500	月2回程度	3月4日	1
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200			
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	4 9 18 27	3月4日	3
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	6 11 18 27	2月27日	4
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200			
25年超	0~500 程度	300	9 23	2月25日	2
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	2月25日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	2月13日	-

1年前の市場推移

○2019年2月積み期 [2月15日~3月15日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



本資料は投資環境等に関する情報提供を目的として作成したものです。本資料は投資勧誘を目的とするものではありません。有価証券等の取引には、リスクが伴います。投資についての最終決定は、投資家ご自身の判断と責任においてなされるようお願いいたします。当社は、いかなる投資の妥当性についても保証するものではありません。記載された意見や予測等は作成時点のものであり、正確性、完全性を保証するものではなく、今後予告なく変更されることがあります。