

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年3月12日(木)

短期市場の推移

[億円] [%]

	3月6日	3月9日	3月10日	3月11日
加重平均金利	▲0.052	▲0.060	▲0.065	▲0.065
東京レポレート(ON)	▲0.137	▲0.130	▲0.094	▲0.095
無コール残	136,600	126,544	111,041	106,536
ON	92,392	83,701	73,308	71,388
その他	44,208	42,843	37,733	35,148
有コール残	17,321	17,597	26,018	24,422

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13日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	23:00 (米)3月ミシガン大学 消費者信頼感指数速報	96.4
-	-	-	-
-	-	-	-

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	▲0.087	0.001	▲0.066	▲0.103
T/N	▲0.060	▲0.035	▲0.059	▲0.153
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.159
2W	-	-	0.005	▲0.163
3W	-	-	-	▲0.188
1M	-	-	-	▲0.196
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.205
6M	-	-	-	▲0.205
1Y	-	-	-	▲0.208

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▲0.070%の出合から始まり、その後は主に▲0.085~▲0.035%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比▲0.001%の▲0.066%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.085	▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.085 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

3日積みではあるが調達サイドの動向に大きな変化はなく、本日と同様の地合になると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報 3月12日	日銀予想 3月13日	当社需給予想 3月16日
券	▲800	▲200	+0
財政	+5,600	▲4,700	+17,000
過不足	+4,800	▲4,900	+17,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+5,000		
国債買入	+4,500		
国債買現先			▲6,500
共通担保(全店)			▲10,100
CP等買入	▲500	▲500	
社債等買入		▲100	
ETF買入	+700	+800	
国債補完供給	+300	+900	
当座預金増減	+13,900	▲3,800	+400
当座預金残高	3,918,700	3,914,900	3,915,300
準備預金残高	3,432,100	主な需給要因	
積み終了先	3,431,800		
超過準備	3,431,800		
非準備先残高	486,600		
準備預金進捗率	99.9%	国債発行(20年)	国庫短期証券 発行・償還(3M)
平均	89.7%		国債発行(個人)
乖離率	10.2%		国債償還(2年)

3月12日のオペ結果 [円][億円]※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(3/12~3/13)						
	769	769	▲0.350	▲0.350		
	90	90	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース [億円]
3月11日時点 5,044,300

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,022,500
3月13日以降の残り所要	
積数	500
平均	200

国庫短期証券入札予定

3月13日	3ヶ月	第894回
3月17日	1年	第895回
3月18日	3ヶ月	第896回
3月27日	3ヶ月	
国債入札予定		
3月26日	40年	
3月31日	2年	
4月2日	10年	
4月7日	30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11日	0
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9日	2
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	6 11 18 27	3月11日	2
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200			
25年超	0~500 程度	300	9 23	3月9日	1
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	3月11日	1
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。

上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会