

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年3月17日(火)

短期市場の推移

[億円][%]

	3月11日	3月12日	3月13日	3月16日
加重平均金利	▲0.065	▲0.066	▲0.067	▲0.068
東京レポレート(ON)	▲0.095	▲0.103	▲0.196	▲0.132
無コール残	106,536	100,660	116,160	98,338
ON	71,388	63,162	81,012	67,495
その他	35,148	37,498	35,148	30,843
有コール残	24,422	23,771	12,653	19,988

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18日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	2月貿易収支	9700億円	21:30	(米)2月住宅着工件数 150.0万戸
8:50	資金循環統計(速報)(10~12月期)	-	21:30	(米)2月住宅建設許可件数 150.0万戸
14:00頃	実質輸出入の動向	-	-	-

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

本日の市況

	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	▲0.068	▲0.350
T/N	▲0.065	▲0.040	▲0.045	▲0.422
S/N	-	-	-	-
1W	0.000	0.002	0.001	▲0.336
2W	-	-	▲0.020	▲0.320
3W	-	-	-	▲0.311
1M	-	-	-	▲0.301
2M	-	-	0.025	-
3M	-	-	0.010	▲0.281
6M	-	-	-	▲0.265
1Y	-	-	-	▲0.258

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

本日の無担保コールON物は▲0.075%の出合から始まり、その後は主に▲0.087~▲0.040%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比横這いの▲0.068%となった。また米ドル供給オベが2種類オファーされ、3か月物としては2008年12月2日以来の高水準となる302億ドルの落札となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.087	▲0.087 ~ ▲0.075	▲0.087 ~ ▲0.035

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、本日と同様の地合になると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	3月17日	3月18日	3月19日
券	▲300	▲500	▲1,000
財政	▲3,100	▲300	+12,000
過不足	▲3,400	▲800	+11,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+2,200	
CP等買入		▲200	
社債等買入		▲200	
ETF買入	+600	+300	
国債補完供給	+1,200	+7,500	
米ドル供給用担保国債供給		▲11,900	
貸出増加支援		▲23,700	+41,500
当座預金増減	▲9,100	+14,700	+11,000
当座預金残高	3,899,300	3,914,000	3,925,000
準備預金残高	3,411,700	主な需給要因	
積み終了先	3,274,000		
超過準備	2,845,500		
非率預先残高	487,600		
準備預金進捗率	95.2%		
平均	6.5%		
乖離率	88.7%		

3月17日のオペ結果 [%][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	接分
国債買入(3/18~)						
3~5年	1,000	5,381	1,002	0.015	0.018	94.4
5~10年	1,000	5,663	1,002	0.018	0.021	19.8
米ドル資金供給(3/19~3/26)						
		2,053	2,053	0.410	0.410	
米ドル資金供給(3/19~6/11)						
		30,272	30,272	0.370	0.370	
国債補完供給(3/17~3/18)						
		6,726	6,726	▲0.450	▲0.450	
		582	582	▲0.450	▲0.450	
米ドル資金供給用担保国債供給(3/18~3/27)						
		5,000	2,409	2,409	▲0.100	▲0.100
米ドル資金供給用担保国債供給(3/18~6/12)						
		10,000	9,333	9,333	▲0.100	▲0.100

マナタリーベース [億円]
3月16日時点 5,048,800

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,247,700
3月18日以降の残り所要積数 157,400
平均 5,400

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

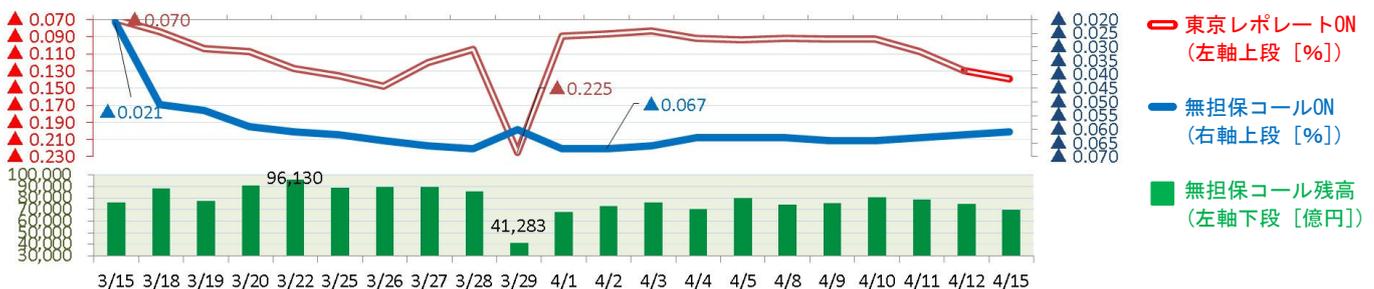
3月18日	3ヶ月	第896回
3月27日	3ヶ月	
4月3日	3ヶ月	
4月9日	6ヶ月	
国債入札予定		
3月26日	40年	
3月31日	2年	
4月2日	10年	
4月7日	30年	

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	1,000~4,500 程度	1,000	4 9 17 18 27	3月9日	2
5年超10年以下	1,000~5,000 程度	1,000	6 11 17 18 27	3月17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3月積み期 [3月15日~4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