

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年3月24日(火)

短期市場の推移

	3月17日	3月18日	3月19日	3月23日
加重平均金利	▲0.068	▲0.063	▲0.051	▲0.048
東京レポレート(ON)	▲0.350	▲0.199	▲0.223	▲0.536
無コール残	102,748	106,619	117,668	121,986
ON	71,975	73,811	76,770	81,458
その他	30,773	32,808	40,898	40,528
有コール残	12,395	10,602	10,633	8,156

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25日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	金融政策決定会合における 主な意見(3月16日分)	-	21:30	(米)2月耐久財受注[前月 比]	-0.9%
	-			-	
	-			-	

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	▲0.039	▲0.833
T/N	▲0.040	0.000	▲0.032	▲0.880
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	▲0.010	▲0.011	▲0.450
2W	-	-	-	▲0.378
3W	-	-	-	▲0.340
1M	-	-	-	▲0.320
2M	-	-	0.050	-
3M	-	-	-	▲0.301
6M	-	-	-	▲0.279
1Y	-	-	-	▲0.273

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▲0.040%の出合から始まり、その後は主に▲0.075~▲0.015%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+0.009%の▲0.039%となった。
また米ドル資金供給オペが2種類オファーされ、3ヵ月物としては過去最高額となる73,805百万米ドルの落札となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.045 ~ ▲0.020	▲0.070 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

引き続き調達意欲は底堅く、出合の水準は小幅上昇を予想。

資金需給

	日銀速報 3月24日	日銀予想 3月25日	当社需給予想 3月26日
券	+100	▲500	▲1,000
財政	▲2,300	+15,900	+11,000
過不足	▲2,200	+15,400	+10,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+2,500	
国債買入		+9,800	
国債売現先		▲8,000	
CP等買入	▲100	+5,000	▲700
ETF買入		+200	+900
国債補完供給	+18,700	▲22,700	+22,700
米ドル供給用担保国債供給		▲43,100	▲98,200
新型コロナ企業金融支援特別貸出		+100	▲100
当座預金増減	▲39,800	▲34,000	+10,000
当座預金残高	3,983,600	3,949,600	3,959,600
準備預金残高	3,469,000	主な需給要因	
積み終了先	3,466,900	年度末諸払い	
超過準備	3,465,600		
非準備先残高	514,600		
準備預金進捗率	99.5%		
平均	29.0%		
乖離率	70.5%		

3月24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
国債売現先(3/25~3/31)	8,000	33,250	8,000	▲0.270	▲0.371	50.0
米ドル資金供給(3/26~4/2)		15,465	15,465	0.360	0.360	
米ドル資金供給(3/26~6/18)		73,805	73,805	0.350	0.350	
国債補完供給(3/24~3/25)		20,739	20,739	▲0.850	▲0.850	
		1,472	1,472	▲0.850	▲0.850	
米ドル資金供給用担保国債供給(3/25~4/3)		20,000	18,398	18,398	▲0.100	▲0.100
米ドル資金供給用担保国債供給(3/25~6/19)		85,000	78,283	78,283	▲0.100	▲0.100

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
3月23日時点 5,165,400	今積期の所要準備額 3,247,700
	3月25日以降の残り所要積数 15,300
	平均 700

国庫短期証券入札予定

3月27日	3ヶ月	第897回
4月3日	3ヶ月	
4月9日	6ヶ月	
4月10日	3ヶ月	
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	2,000			
3年超5年以下	1,000~4,500 程度	3,000	4 9 17 18 27	3月19日	1
5年超10年以下	1,000~5,000 程度	5,000	6 11 17 18 27	3月23日	1
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23日	0
物価連動債	300 程度	500	月2回程度	3月18日	0
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。