

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年3月30日(月)

短期市場の推移

[億円][%]

	3月24日	3月25日	3月26日	3月27日
加重平均金利	▲0.039	▲0.028	▲0.020	▲0.017
東京レポレート(ON)	▲0.833	▲0.229	▲0.191	▲0.126
無コール残	116,487	118,396	121,727	116,856
ON	80,484	83,393	85,824	82,973
その他	36,003	35,003	35,903	33,883
有コール残	7,863	8,752	7,457	10,663

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31日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	2月有効求人倍率	1.47倍	22:00	(米)1月S&P/コアロジックCS20都市住宅価格指数 [前年比]
8:30	2月失業率	+2.4%	22:45	(米)3月MNIシカゴ購買部協会景気指数
	-	-	23:00	(米)3月消費者信頼感指数

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	▲0.017	▲0.168
T/N	▲0.150	▲0.050	▲0.120	▲0.575
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.003	0.002	▲0.001	▲0.262
2W	-	-	-	▲0.215
3W	-	-	-	▲0.191
1M	-	-	0.000	▲0.190
2M	-	-	0.000	-
3M	-	-	-	▲0.196
6M	-	-	-	▲0.237
1Y	-	-	-	▲0.246

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▲0.010%の出合から始まり、その後は主に▲0.030~▲0.003%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▲0.017%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.020 ~ ▲0.005	▲0.030 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

年度末初の取引となるため、一部のビッドサイドは調達を控える動きが予想される。

資金需給

[億円]

	日銀速報 3月30日	日銀予想 3月31日	当社需給予想 4月1日
券	▲600	▲100	+1,000
財政	+38,800	+10,700	▲20,000
過不足	+38,200	+10,600	▲19,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+11,500		
国債売現先	▲8,000	+16,000	▲20,100
共通担保(全店)	▲8,800	+10,800	+20,000
CP等買入	▲700	▲4,200	+5,500
ETF買入	+300		+200
国債補完供給	+1,600	▲1,900	+1,900
米ドル供給用担保国債供給	▲15,800	▲21,800	
当座預金増減	+27,200	▲11,900	+1,000
当座預金残高	3,972,900	3,961,000	3,962,000
準備預金残高	3,435,900	主な需給要因	
積み終了先	3,435,300	年度末諸払い	国債発行(2年)
超過準備	3,435,300		
非準備先残高	537,000		
準備預金進捗率	99.8%		
平均	48.4%		
乖離率	51.4%		

3月30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
米ドル資金供給(4/1~4/8)	24,100	24,100	0.320	0.320		
国債補完供給(3/30~3/31)	1,816	1,816	▲0.450	▲0.453		
米ドル資金供給用担保国債供給(3/31~4/9)	30,000	21,280	21,280	▲0.100	▲0.100	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
3月27日時点 5,090,600	今積期の所要準備額 3,247,700
	3月31日以降の残り所要積数 5,800
	平均 400

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

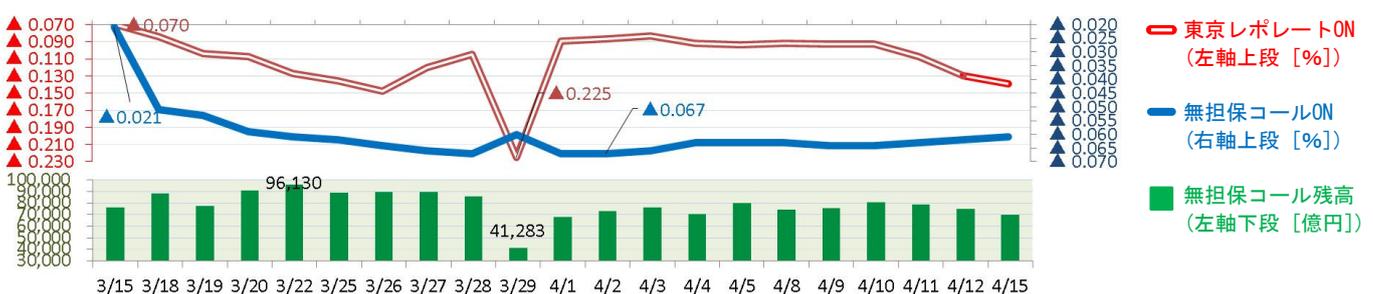
4月3日	3ヶ月	第898回
4月9日	6ヶ月	
4月10日	3ヶ月	
4月16日	1年	
3月31日	2年	
4月2日	10年	
4月7日	30年	
4月9日	5年	

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月27日	0
3年超5年以下	1,000~4,500 程度	3,400	4 9 17 18 27	3月27日	0
5年超10年以下	1,000~5,000 程度	3,500	6 11 17 18 27	3月27日	0
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200		3月23日	0
25年超	0~500 程度	300	9 23		
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。 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