

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年4月2日(木)

短期市場の推移

	3月27日	3月30日	3月31日	4月1日
加重平均金利	▲0.017	▲0.017	▲0.070	▲0.022
東京レポレート(ON)	▲0.126	▲0.168	▲0.615	▲0.116
無コール残	116,856	114,136	84,301	119,308
ON	82,973	80,583	63,203	79,685
その他	33,883	33,553	21,098	23,683
有コール残	10,663	7,704	6,685	15,940

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。

4月3日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
14:00	需給ギャップと潜在成長率	-	21:30	(米)3月非農業部門雇用者数 -6.1万人
	-		21:30	(米)3月失業率 3.9%
	-		23:00	(米)3月ISM非製造業景況指数 48.5

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	▲0.087	0.001	▲0.020	▲0.100
T/N	▲0.080	▲0.005	▲0.065	▲0.103
S/N	-	-	-	-
1W	0.002	-	-	▲0.114
2W	▲0.010	0.000	▲0.006	▲0.127
3W	-	-	-	▲0.136
1M	▲0.001	-	-	▲0.155
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.165
6M	-	-	-	▲0.214
1Y	-	-	-	▲0.224

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▲0.020%の出合から始まり、その後は主に▲0.030~▲0.005%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+0.002%の▲0.020%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.025		▲0.020 ~ ▲0.010	▲0.025 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

本日同様、堅調な地合が継続すると予想する。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	4月2日	4月3日	4月6日
券	▲1,100	▲200	+1,000
財政	▲13,700	▲22,900	▲3,000
過不足	▲14,800	▲23,100	▲2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	▲3,400	▲100	▲100
国債売現先	+8,000	+12,000	+12,000
CP等買入	-	-	-
ETF買入	+100	-	-
国債補完供給	+1,200	+1,400	+1,400
米ドル供給用担保国債供給	+43,100	+18,600	+2,700
当座預金増減	+39,200	+8,400	+700
当座預金残高	3,956,200	3,964,600	3,965,300
準備預金残高	3,441,200	主な需給要因	
積み終了先	3,441,000		
超過準備	3,441,000		
非準預先残高	515,000	国債発行(10年)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	58.1%		
乖離率	41.8%		

4月2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(4/6~4/13)	1,135	1,135	0.320	0.320		
国債補完供給(4/2~4/3)	1,344	1,344	▲0.350	▲0.350		
米ドル資金供給用担保国債供給(4/3~4/14)	5,000	366	366	▲0.100	▲0.100	

マナタリーベース [億円]
4月1日時点 5,062,800

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,247,700
4月3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

4月3日	3ヶ月	第898回
4月9日	6ヶ月	第899回
4月10日	3ヶ月	
4月16日	1年	
4月7日	30年	
4月9日	5年	
4月21日	20年	
4月23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	500~1,000 程度	500	月3回程度	3月11日	3
1年超3年以下	2,000~4,500 程度	4,200	3 8 13 15 17 27	3月27日	6
3年超5年以下	1,500~4,000 程度	2,800	3 13 17 22 27	4月1日	5
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	6 8 13 22 27	3月27日	5
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200	3 24	3月23日	2
25年超	0~500 程度	300	3 24	3月23日	2
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	4月1日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	2月13日	1

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