

# DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年4月3日(金)

## 短期市場の推移

	3月30日	3月31日	4月1日	4月2日
加重平均金利	▲0.017	▲0.070	▲0.022	▲0.020
東京レポレート(ON)	▲0.168	▲0.615	▲0.116	▲0.100
無コール残	114,136	84,301	103,368	108,291
ON	80,583	63,203	79,685	80,603
その他	33,553	21,098	23,683	27,688
有コール残	7,704	6,685	15,940	9,578

## 4月6日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
	-	-	-	-
	-	-	-	-
	-	-	-	-

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。

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	▲0.017	▲0.099
T/N	-	-	▲0.080	▲0.142
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	0.000	▲0.006	▲0.135
2W	-	-	▲0.015	▲0.138
3W	0.001	0.003	0.002	▲0.146
1M	-	-	0.080	▲0.160
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.163
6M	-	-	-	▲0.211
1Y	-	-	-	▲0.226

## 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.015%の出合から始まり、その後は主に▲0.025%~▲0.010%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+0.003%の▲0.017%となった。

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

## 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。

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

## 資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	4月3日	4月6日	4月7日
券	▲300	+1,000	+1,000
財政	▲23,300	▲10,900	+1,000
過不足	▲23,600	▲9,900	+2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+7,800	スタート
国債売現先	+12,000		+2,000
共通担保(全店)			
CP等買入	▲100		+200
ETF買入			
国債補完供給	+1,400	▲3,400	+3,400
米ドル供給用担保国債供給	+18,600	▲400	+2,700
			+1,400
当座預金増減	+4,500	▲100	+3,400
当座預金残高	3,960,700	3,960,600	3,964,000
準備預金残高	3,445,300		
積み終了先	3,445,100		
超過準備	3,445,100		
非準預先残高	515,400		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	67.7%		
乖離率	32.2%		

## 4月3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(4/6~)						
1~3年	3,200	6,838	3,201	0.007	0.010	38.1
3~5年	2,800	8,251	2,803	0.012	0.014	29.9
10~25年	1,200	3,342	1,203	0.001	0.002	98.3
25年~	300	971	300	▲0.002	▲0.002	
米ドル資金供給(4/7~4/14)		5,750	5,750	0.320	0.320	
国債補完供給(4/3~4/6)		1,960	1,960	▲0.350	▲0.350	
		1,365	1,365	▲0.350	▲0.350	
共通担保(全店)(4/6~4/13)	15,000	2,000	2,000			
米ドル資金供給用担保国債供給(4/6~4/15)	10,000	6,132	6,132	▲0.100	▲0.100	

マナタリーベース [億円]	所要
4月2日時点 5,103,200	今積期の所要準備額 3,247,700
	4月6日以降の残り所要積数 1,500
	平均 100

## 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	

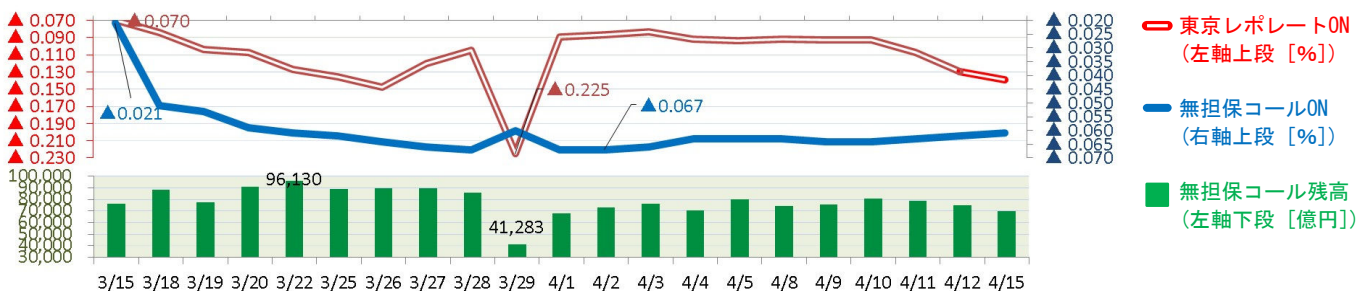
## 今月の国債買入オペ予定

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	3月31日	3月11日	3
1年超3年以下	2,000~4,500 程度	4,200	3月13日	3月15日	5
3年超5年以下	1,500~4,000 程度	2,800	3月13日	3月17日	5
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	3月13日	3月22日	5
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200	3月24日	3月24日	1
25年超	0~500 程度	300	3月24日	3月23日	1
物価連動債	300 程度	300	4月1日	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