

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年4月6日(月)

短期市場の推移

	3月31日	4月1日	4月2日	4月3日
加重平均金利	▲0.070	▲0.022	▲0.020	▲0.017
東京レポレート(ON)	▲0.615	▲0.116	▲0.100	▲0.099
無コール残	84,301	103,368	108,291	107,986
ON	63,203	79,685	80,603	77,398
その他	21,098	23,683	27,688	30,588
有コール残	6,685	15,940	9,578	15,594

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7日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:00	営業毎旬報告 (3月31日現在)	-	23:00	(米)2月JOLT求人件数
15:00	コール市場残高(3月)	-	-	-
	-	-	-	-

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	▲0.022	▲0.122
T/N	-	-	▲0.080	▲0.160
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.008	▲0.150
2W	-	-	-	▲0.152
3W	-	-	-	▲0.156
1M	-	-	0.003	▲0.169
2M	-	-	0.000	-
3M	-	-	-	▲0.156
6M	-	-	-	▲0.214
1Y	-	-	-	▲0.225

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▲0.015%の出合から始まり、その後は主に▲0.030%~▲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▲0.005%の▲0.022%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.025	▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.030 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

本日同様、出合水準は低下すると予想。

資金需給

	日銀速報 4月6日	日銀予想 4月7日	当社需給予想 4月8日
券	+800	▲400	+0
財政	▲6,800	+8,800	▲6,000
過不足	▲6,000	+8,400	▲6,000
金融調節	エンド スタート	エンド スタート	エンド スタート
国債買入	+7,800	+5,800	-
共通担保(全店)	+2,000	-	-
CP等買入	-	▲200	-
社債等買入	-	▲200	-
ETF買入	+200	+700	-
国債補完供給	+3,400	+1,900	-
米ドル供給用担保国債供給	+2,700	+1,400	+15,200
			+15,400
当座預金増減	+1,900	+2,600	+9,400
当座預金残高	3,962,600	3,965,200	3,974,600
準備預金残高	3,441,900	主な需給要因	
積み終了先	3,441,700		
超過準備	3,441,700		
非準備先残高	520,700	国債発行(30年)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	71.0%		
乖離率	28.9%		

4月6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(4/7~)						
~1年	800	2,367	801	0.001	0.007	8.2
5~10年	3,500	10,605	3,504	0.015	0.019	82.5
変動利付	1,000	3,520	1,003	▲0.280	▲0.286	97.5
米ドル資金供給(4/8~4/15)						
		12,880	12,880	0.310	0.310	
国債補完供給(4/6~4/7)						
		1,874	1,874	▲0.350	▲0.352	
		0	0			
米ドル資金供給用担保国債供給(4/7~4/16)						
		15,000	14,798	14,798	▲0.100	▲0.100

マナタリーベース [億円]	所要
4月3日時点 5,108,000	今積期の所要準備額 3,247,700
	4月7日以降の残り所要積数 1,300
	平均 100

国庫短期証券入札予定

4月9日	6ヶ月	第899回
4月10日	3ヶ月	第900回
4月16日	1年	
4月17日	3ヶ月	
4月7日	30年	
4月9日	5年	
4月21日	20年	
4月23日	2年	

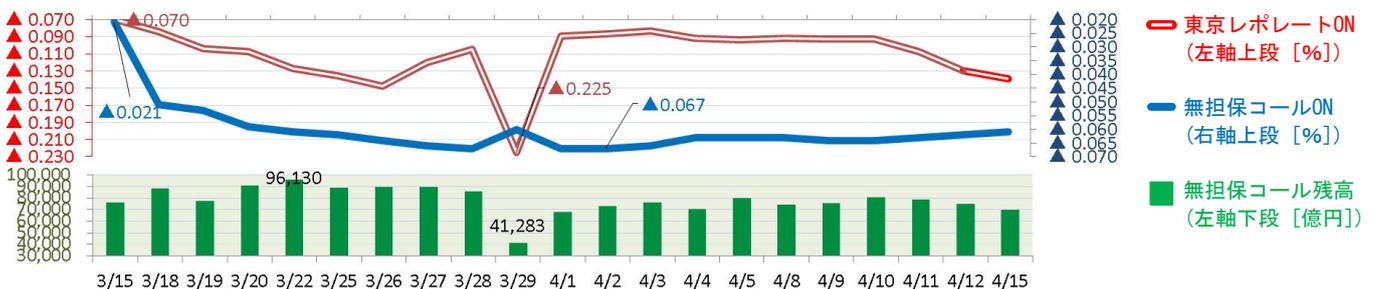
今月の国債買入オペ予定

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	800	月3回程度	4月6日	2
1年超3年以下	2,000~4,500 程度	3,200	3 8 13 15 17 27	4月6日	5
3年超5年以下	1,500~4,000 程度	2,800	1 3 13 17 22 27	4月3日	4
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	6 8 13 22 27	4月6日	4
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200	3 24	4月3日	1
25年超	0~500 程度	300	3 24	4月3日	1
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	4月6日	0

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。