

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年4月8日(水)

## 短期市場の推移

	4月2日	4月3日	4月6日	4月7日
加重平均金利	▲0.020	▲0.017	▲0.022	▲0.035
東京レポレート(ON)	▲0.100	▲0.099	▲0.122	▲0.146
無コール残	108,291	107,986	101,150	103,852
ON	80,603	77,398	70,007	71,669
その他	27,688	30,588	31,143	32,183
有コール残	9,578	15,594	7,167	10,586

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9日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:00頃	【挨拶】黒田総裁(支店長会議)	-	21:30	(米)生産者物価コア指数(3月) 1.2%
14:00	地域経済報告(4月)	-	21:30	(米)新規失業保険申請件数 -
			23:00	(米)シガン大学消費者信頼感指数(4月速報) 80.0

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	▲0.150	0.001	▲0.046	▲0.233
T/N	-	-	▲0.080	▲0.408
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	0.001	▲0.012	▲0.275
2W	-	-	-	▲0.243
3W	-	-	-	▲0.241
1M	0.070	0.300	0.185	▲0.249
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.050	▲0.205
6M	-	-	-	▲0.226
1Y	-	-	-	▲0.233

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券協会公表

## 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.04%の出合から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.020%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▲0.011%の▲0.046%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.070	▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.070 ~ ▲0.020

## 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	日銀予想	当社需給予想
	4月8日	4月9日	4月10日
券	+100	▲1,000	▲1,000
財政	▲8,800	▲700	▲14,000
過不足	▲8,700	▲1,700	▲15,000
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		▲300	
CP等買入			+1,500
ETF買入	+300		
国債補完供給	+2,300	▲700	+700
米ドル供給用担保国債供給	+15,800	▲34,700	+21,800
			+10,800
当座預金増減	▲23,200	+28,800	▲4,200
当座預金残高	3,943,100	3,971,900	3,967,700
準備預金残高	3,402,400	主な需給要因	
積み終了先	3,402,300		
超過準備	3,402,300		
非準備先残高	540,700	国庫短期証券発行・償還(6M)	
準備預金進捗率	99.9%	国債発行(5年)	
平均	77.4%		
乖離率	22.5%		

## 4月8日のオペ結果 [%(億ドル)] ※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(4/9~)						
1~3年	3,200	9,621	3,201	▲0.004	0.001	44.8
5~10年	3,500	8,518	3,508	0.007	0.010	65.1
米ドル資金供給(4/10~4/17)						
		1,080	1,080	0.300	0.300	
国債補完供給(4/8~4/9)						
		738	738	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マネタリーベース [億円]  
4月7日時点 5,113,400

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,255,300  
4月9日以降の残り所要積数 1,000  
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	
国債入札予定		
4月9日	5年	
4月21日	20年	
4月23日	2年	
5月8日	物価連動	

## 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8日	4
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8日	3
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。 上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会