

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年4月9日(木)

## 短期市場の推移

	4月3日	4月6日	4月7日	4月8日
加重平均金利	▲0.017	▲0.022	▲0.035	▲0.046
東京レポレート(ON)	▲0.099	▲0.122	▲0.146	▲0.233
無コール残	107,986	101,150	103,852	101,522
ON	77,398	70,007	71,669	68,959
その他	30,588	31,143	32,183	32,563
有コール残	15,594	7,167	10,586	7,163

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10日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	3月国内企業物価指数 [前年比]	+0.0%	21:30	(米)3月消費者物価コア 指数[前年比]	2.3%
	-			(米)財政収支	
	-			-	

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	▲0.085	0.001	▲0.048	▲0.205
T/N	-	-	▲0.015	▲0.200
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.203
2W	-	-	0.310	▲0.204
3W	-	-	-	▲0.207
1M	-	-	-	▲0.219
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.185
6M	-	-	-	▲0.221
1Y	-	-	-	▲0.228

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▲0.045%の出合から始まり、その後は主に▲0.070%~▲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▲0.002%の▲0.048%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.070 ~ ▲0.040	▲0.070 ~ ▲0.020

## 翌営業日のマーケット

週末3日積みとなることから、出合の水準は本日よりも上昇する見込み。

## 資金需給

	日銀速報 4月9日	日銀予想 4月10日	当社需給予想 4月13日
券	▲1,300	▲300	+1,000
財政	+1,800	▲18,900	▲3,000
過不足	+500	▲19,200	▲2,000
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	+6,800		
共通担保(全店) CP等買入 社債等買入 ETF買入	▲300	▲100	▲14,300
国債補完供給	+700	+2,300	+1,500
米ドル資金供給用担保国債供給	+21,800	+11,100	+400
当座預金増減	+28,700	▲2,800	▲14,400
当座預金残高	3,971,800	3,969,000	3,954,600
準備預金残高	3,428,200	主な需給要因	
積み終了先	3,428,100		
超過準備	3,428,100		
非準備先残高	543,600	国庫短期証券 発行・償還(6M)	国庫短期証券 発行・償還(3M)
準備預金進捗率	99.9%	国債発行(5年)	
平均	80.6%		
乖離率	19.3%		

## 4月9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(4/13~4/20)	998	998	0.310	0.310		
国債補完供給(4/9~4/10)	1,987	1,987	▲0.450	▲0.450		
	272	272	▲0.450	▲0.450		

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
4月8日時点 5,090,100	今積期の所要準備額 3,255,300
	4月10日以降の残り所要積数 900
	平均 100

## 国庫短期証券入札予定

4月10日	3ヶ月	第900回
4月16日	1年	第901回
4月17日	3ヶ月	
4月24日	3ヶ月	
4月21日	20年	
4月23日	2年	
5月8日	物価運動	
5月12日	10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
物価運動債	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。