

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年4月16日(木)

短期市場の推移

	4月10日	4月13日	4月14日	4月15日
加重平均金利	▲0.032	▲0.019	▲0.010	▲0.009
東京レポレート(ON)	▲0.094	▲0.085	▲0.082	▲0.087
無コール残	105,994	99,367	101,892	101,314
ON	71,861	64,884	65,709	65,086
その他	34,133	34,483	36,183	36,228
有コール残	18,365	17,785	18,377	17,957

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17日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
4月月例経済報告(内閣府)		11:00 (中)1-3月期国内総生産(GDP)[前年比]	-6.0%
-		11:00 (中)3月鉱工業生産指数[前年比]	-5.4%
-		11:00 (中)3月小売売上高[前年比]	-10.0%

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	▲0.070	0.001	▲0.044	▲0.124
T/N	-	-	▲0.001	▲0.136
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.015	▲0.018	▲0.124
2W	-	-	▲0.010	▲0.130
3W	-	-	-	▲0.135
1M	-	-	▲0.001	▲0.142
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.149
6M	-	-	-	▲0.191
1Y	-	-	-	▲0.203

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

積み初日となる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▲0.070%~▲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▲0.035%の▲0.044%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.065	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.070 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

調達サイドの動向に大きな変化はなく、本日と同様の地合になると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月16日	4月17日	4月17日	4月20日	4月20日	4月20日
券	▲1,200	▲1,100		+0		
財政	+5,800	+8,100		+2,000		
過不足	+4,600	+7,000		+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		+4,000				
CP等買入			▲200	+5,500		
社債等買入			▲300			
ETF買入				+1,600		
被災地金融機関支援			▲1,300	+1,300		
国債補完供給		▲300	+300			
米ドル資金供給用担保国債供給	+15,200		+11,100			
当座預金増減	+23,500	+25,000		+2,000		
当座預金残高	4,076,100	4,101,100		4,103,100		
準備預金残高	3,536,200	主な需給要因				
積み終了先	2,119,800					
超過準備	926,300					
非準備先残高	539,900					
準備預金進捗率	81.3%					
平均	3.3%					
乖離率	78.0%					

4月16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(4/20~4/27)	664	664	0.300	0.300		
国債補完供給(4/16~4/17)	267	267	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
4月15日時点 5,202,000

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,209,400
4月17日以降の残り所要積数 599,500
平均 20,700

国庫短期証券入札予定

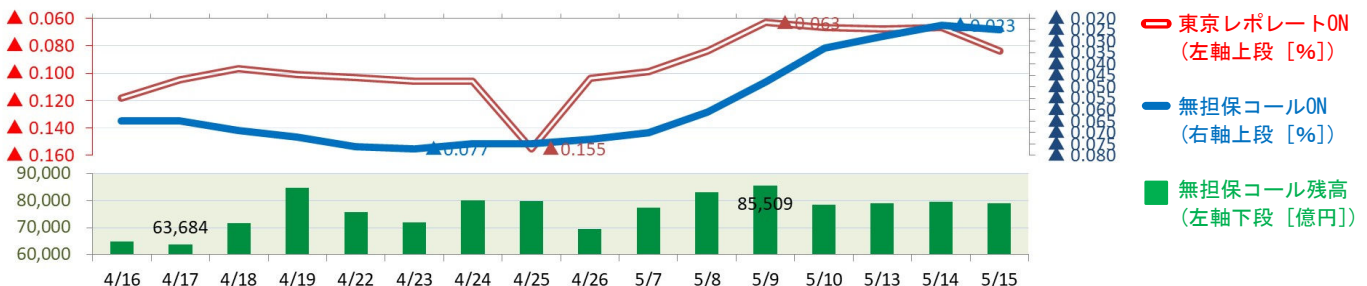
4月17日	3ヶ月	第902回
4月24日	3ヶ月	
5月1日	3ヶ月	
5月7日	6ヶ月	
4月21日	20年	
4月23日	2年	
5月8日	物価運動	
5月12日	10年	

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15日	1
1年超3年以下	2,000~4,500 程度	3,200	3 8 13 15 17 27	4月15日	2
3年超5年以下	1,500~4,000 程度	2,800	1 3 13 17 22 27	4月13日	3
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	6 8 13 22 27	4月13日	2
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4月積み期 [4月16日~5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