

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年3月8日(金)

短期市場の推移

[億円][%]

3月11日の予定(時刻は日本時間)

	3月4日	3月5日	3月6日	3月7日
加重平均金利	▲0.047	▲0.042	▲0.034	▲0.029
東京レポレート(ON)	▲0.029	▲0.032	▲0.031	▲0.032
無コール残	86,549	84,580	85,650	85,899
ON	61,649	59,230	60,970	62,419
その他	24,900	25,350	24,680	23,480
有コール残	21,411	21,536	21,480	21,429

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネーストック(2月)	-	21:30	(米)1月小売売上高 0.1%
	-		23:00	(米)12月企業在庫 0.6%
	-			ユーロ圏財務相会合

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	▲0.080	0.001	▲0.027	▲0.019
T/N	-	-	▲0.020	▲0.006
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	0.002	▲0.022	▲0.026
2W	▲0.030	▲0.005	▲0.015	▲0.052
3W	-	-	0.030	▲0.095
1M	-	-	-	▲0.108
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.129
6M	-	-	-	▲0.152
1Y	-	-	-	▲0.155

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▲0.035%の出合から始まった。その後は主に▲0.040~▲0.010%の水準で出合が見られた。週末3日積みのため、調達意欲は強く、同加重平均金利(速報)は、前営業日対比+0.002%の▲0.027%と6営業日連続で上昇した。

業態別出合レンジ

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.030	▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.035 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

資金調達ニーズは引き続き強く、堅調な地合を予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	3月8日	3月11日	3月11日	3月12日	3月12日	3月12日
券	▲200	+800	+800	+1,000	+1,000	+1,000
財政	▲7,900	▲7,900	▲7,900	+3,000	+3,000	+3,000
過不足	▲8,100	▲7,100	▲7,100	+4,000	+4,000	+4,000
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				+8,100		
共通担保(全店)			▲4,900	+4,800		
CP等買入	▲400	+3,500	▲600			
ETF買入						
国債補完供給	+200	▲200	+200			
社債買入	▲200					
当座預金増減	▲5,200	+500	+500	+4,000	+4,000	+4,000
当座預金残高	3,753,600	3,754,100	3,754,100	3,758,100	3,758,100	3,758,100
準備預金残高	3,314,500					
積み終了先	3,314,400					
超過準備	3,314,300					
非準備預金残高	439,100					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	82.1%					
乖離率	17.8%					

3月8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(3/11~)						
~1年	500	1,729	500	0.100	0.113	50.0
1~3年	3,500	11,592	3,506	0.000	0.001	42.3
3~5年	4,000	15,557	4,008	▲0.009	▲0.008	14.8
国債補完供給(3/8~3/11)						
24,270	150	150	▲0.500	▲0.500		
10,000	24	24	▲0.500	▲0.500		
共通担保(全店)(3/11~3/12)						
20,000	0	0				
共通担保(全店)(3/11~3/25)						
15,000	4,781	4,781				

マナタリーベース [億円]
3月7日時点 4,878,700

所要 [億円]
今積期の所要準備額 2,813,500
3月11日以降の残り所要
積数 500
平均 100

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

3月14日	3ヶ月	第820回
3月19日	1年	
3月22日	3ヶ月	
4月3日	3ヶ月	
国債入札予定		
3月12日	5年	
3月19日	20年	
3月26日	40年	
3月28日	2年	

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	100~1,000 程度	500	月2回程度	3月8日	1
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	4 6 18 25	3月8日	2
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	6 13 20 29	3月6日	3
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	100~1,000 程度	500	4 13 25 29	3月4日	3
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	3月6日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	2月14日	1

1年前の市場推移

○2018年2月積み期 [2月16日~3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。