

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年3月11日(月)

## 短期市場の推移

[億円][%]

3月12日の予定(時刻は日本時間)

	3月5日	3月6日	3月7日	3月8日
加重平均金利	▲0.042	▲0.034	▲0.029	▲0.027
東京レポレート(ON)	▲0.032	▲0.031	▲0.032	▲0.019
無コール残	84,580	85,650	85,899	88,948
ON	59,230	60,970	62,419	61,618
その他	25,350	24,680	23,480	27,330
有コール残	21,536	21,480	21,429	20,985

	日本	予想	海外	予想
10:00	営業毎月報告 (3月10日現在)	-	21:30	(米)2月消費者物価 コア指数[前年比]
	-		-	2.2%
	-		-	

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	▲0.024	▲0.018
T/N	-	-	▲0.020	▲0.017
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	0.001	▲0.009	▲0.043
2W	-	-	-	▲0.062
3W	-	-	-	▲0.104
1M	-	-	-	▲0.108
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.131
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.154

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~▲0.015%の水準で出合が見られた。引き続き資金調達ニーズは強く、同加重平均金利(速報)は、前営業日対比+0.003%の▲0.024%と7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 ~ ▲0.035	▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.070 ~ ▲0.015

## 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11日	3月12日	3月13日
券	+700	+300	+0
財政	▲9,300	+5,700	▲23,000
過不足	▲8,600	+6,000	▲23,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+8,100		スタート
共通担保(全店)	▲4,900	+4,800	
CP等買入	▲600	▲300	
国債補完供給	+200	▲1,000	+1,000
当座預金増減	▲2,000	+6,700	▲23,000
当座預金残高	3,751,600	3,758,300	3,735,300
準備預金残高	3,291,200	主な需給要因	
積み終了先	3,291,000		
超過準備	3,291,000		
非準備預金残高	460,400	源泉税揚げ 国債発行(5年)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	85.7%		
乖離率	14.2%		

3月11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

国債補完供給(3/11~3/12)	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
	106,226	927	927	▲0.500	▲0.500	
	31,167	1	1	▲0.500	▲0.500	

マナタリーベース [億円]  
3月8日時点 4,873,700

所要	[億円]
今積期の所要準備額	2,813,500
3月12日以降の残り所要積数	500
平均	100

## 国庫短期証券入札予定

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	

## 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	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。