

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年3月20日(水)

短期市場の推移

[億円][%]

3月22日の予定(時刻は日本時間)

	3月14日	3月15日	3月18日	3月19日
加重平均金利	▲0.023	▲0.021	▲0.051	▲0.053
東京レポレート(ON)	▲0.055	▲0.070	▲0.084	▲0.104
無コール残	80,112	76,163	88,403	77,778
ON	58,262	56,293	67,563	57,033
その他	21,850	19,870	20,840	20,745
有コール残	21,217	19,637	20,581	18,290

日本		予想	海外		予想
8:30	2月消費者物価コア指数[前年比]	+0.8%	22:45	(米)3月製造業PMI	54.0
	国債市場特別参加者会合(財務省)		23:00	(米)2月中古住宅販売件数	508万件
				(米)アトランタ連銀総裁の講演	

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	▲0.086	0.001	▲0.059	▲0.107
T/N	-	-	▲0.020	▲0.143
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.027	0.001	▲0.012	▲0.139
2W	-	-	▲0.015	▲0.161
3W	-	-	-	▲0.144
1M	-	-	-	▲0.138
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.137
6M	-	-	-	▲0.154
1Y	-	-	-	▲0.156

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▲0.060%の出合から始まり、その後は主に▲0.086~▲0.020%のレンジで取引された。2日積みではあったものの、軟調な地合となり、同加重平均金利(速報)は、前営業日対比▲0.006%の▲0.059%と3営業日連続で低下した。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086		▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.075 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

3日積みとなるものの、本日と同様に軟調な地合が予想される。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	3月20日	3月22日	3月22日	3月25日	3月25日
券	▲1,700	▲800	▲800	+0	
財政	+96,900	+2,500	+2,500	+24,000	
過不足	+95,200	+1,700	+1,700	+24,000	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入				+5,400	
共通担保(全店)				▲4,800	
CP等買入	▲1,200		▲1,100		
社債等買入	▲800		▲100		+800
ETF買入		+400		+700	
国債補完供給	+800	▲1,000	+1,000		
当座預金増減	+93,400	+7,600	+7,600	+20,000	
当座預金残高	3,880,300	3,887,900	3,887,900	3,907,900	
準備預金残高	3,383,500	主な需給要因			
積み終了先	3,372,900				
超過準備	3,366,600				
非準備先残高	496,800				
準備預金進捗率	99.1%	国庫短期証券発行・償還(3M)			
平均	19.4%				
乖離率	79.7%				

3月20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(3/22~)						
~1年	500	1,134	500	▲0.026	▲0.017	94.7
5~10年	4,800	15,417	4,810	0.001	0.002	39.4
米ドル資金供給(3/22~3/28)		1	1	2,900	2,900	
国債補完供給(3/20~3/22)	63,735	941	941	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
3月19日時点 4,906,200	今積期の所要準備額 3,096,400
	3月22日以降の残り所要積数 28,200
	平均 1,100

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

3月22日	3ヶ月	第822回
4月3日	3ヶ月	
4月5日	3ヶ月	
4月9日	6ヶ月	
3月26日	40年	
3月28日	2年	
4月2日	10年	
4月4日	30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20日	0
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18日	1
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	6 13 20 29	3月20日	1
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13日	2
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	3月18日	0
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	2月14日	-

1年前の市場推移

○2018年3月積み期 [3月16日~4月13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。