

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年3月22日(金)

短期市場の推移

[億円][%]

3月25日の予定(時刻は日本時間)

	3月15日	3月18日	3月19日	3月20日
加重平均金利	▲0.021	▲0.051	▲0.053	▲0.059
東京レポレート(ON)	▲0.070	▲0.084	▲0.104	▲0.107
無コール残	76,163	88,403	77,778	91,127
ON	56,293	67,563	57,033	68,202
その他	19,870	20,840	20,745	22,925
有コール残	19,637	20,581	18,290	19,192

	日本	予想	海外	予想
10:00	営業毎旬報告 (3月20日現在)	-	21:30	(米)2月シカゴ連銀 全米活動指数 -0.25
	-		-	
	-		-	

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	▲0.061	▲0.127
T/N	-	-	▲0.020	▲0.140
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.013	▲0.031	▲0.202
2W	-	-	0.030	▲0.166
3W	-	-	-	▲0.144
1M	-	-	-	▲0.137
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.138
6M	-	-	-	▲0.154
1Y	-	-	-	▲0.156

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.070%の出合から始まり、その後は主に▲0.086~▲0.025%のレンジで取引された。3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▲0.002%の▲0.061%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086		▲0.085 ~ ▲0.085	▲0.080 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドは慎重な調達姿勢になると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報 3月22日	日銀予想 3月25日	当社需給予想 3月26日
券	▲900	▲400	+0
財政	▲400	+22,700	+6,000
過不足	▲1,300	+22,300	+6,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+5,400	
共通担保(全店)		▲4,800	+5,100
CP等買入	▲1,100	▲800	
社債等買入	▲100		+800
ETF買入		+700	+400
国債補完供給	+1,000	▲900	+900
当座預金増減	+3,700	+23,900	+6,000
当座預金残高	3,884,000	3,907,900	3,913,900
準備預金残高	3,390,300	主な需給要因	
積み終了先	3,389,100		
超過準備	3,385,700		
非準備預金残高	493,700	国庫短期証券 発行・償還(3M)	
準備預金進捗率	99.5%		
平均	29.0%		
乖離率	70.5%		

3月22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(3/22~3/25)	109,657	919	919	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(3/25~4/8)	15,000	5,131	5,131			

マナタリーベース [億円]
3月20日時点 5,001,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,096,400
3月25日以降の残り所要積数 14,300
平均 600

国庫短期証券入札予定

4月3日	3ヶ月
4月5日	3ヶ月
4月9日	6ヶ月
4月12日	3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

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。