

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年3月27日(水)

短期市場の推移

[億円][%]

3月28日の予定(時刻は日本時間)

	3月20日	3月22日	3月25日	3月26日
加重平均金利	▲0.059	▲0.061	▲0.062	▲0.064
東京レポレート(ON)	▲0.107	▲0.127	▲0.136	▲0.148
無コール残	91,127	96,130	88,873	89,570
ON	68,202	66,125	58,158	65,800
その他	22,925	30,005	30,715	23,770
有コール残	19,192	14,039	13,964	12,513

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)新規失業保険申請件数[前週分]	-
-	-	(米)セントルイス連銀総裁講演	-
-	-	(米)クラリダFRB副議長講演	-

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	▲0.067	▲0.120
T/N	-	-	▲0.020	▲0.119
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	0.030	▲0.016	▲0.193
2W	▲0.020	0.030	▲0.015	▲0.150
3W	-	-	-	▲0.145
1M	-	-	▲0.025	▲0.143
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.143
6M	-	-	-	▲0.154
1Y	-	-	-	▲0.156

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.075%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。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比▲0.003%の▲0.067%と7営業日連続で低下した。

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

翌営業日のマーケット

引き続き軟調な地合を予想する。

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

資金需給

[億円]

	日銀速報 3月27日	日銀予想 3月28日	当社需給予想 3月29日
券	▲400	▲1,100	▲1,300
財政	▲9,700	+29,400	+11,100
過不足	▲10,100	+28,300	+9,800
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+5,000		
CP等買入	▲400	▲1,300	
ETF買入	+300		+3,500
国債補完供給	▲100	+100	
当座預金増減	▲5,300	+27,100	+13,300
当座預金残高	3,914,900	3,942,000	3,955,300
準備預金残高	3,425,100	主な需給要因	
積み終了先	3,423,600		
超過準備	3,423,600		
非準備預金残高	489,800		
準備預金進捗率	99.7%	年度末諸払い	年度末諸払い
平均	38.7%		
乖離率	61.0%		

3月27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(3/27~3/28)	18,699	101	101	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]
3月26日時点 5,042,500

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,096,400
3月28日以降の残り所要積数	9,300
平均	500

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

4月3日	3ヶ月	第823回
4月5日	3ヶ月	
4月9日	6ヶ月	
4月12日	3ヶ月	
国債入札予定		
3月28日	2年	
4月2日	10年	
4月4日	30年	
4月9日	5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月25日	0
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	4 6 18 25	3月20日	1
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	6 13 20 29	3月25日	1
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800	4 13 25 29	3月18日	0
25年超	100~1,000 程度	500		2月14日	-
物価連動債	250 程度	250	月2回程度		
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000			

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。