

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年4月2日(火)

短期市場の推移

[億円][%]

4月3日の予定(時刻は日本時間)

	3月27日	3月28日	3月29日	4月1日
加重平均金利	▲0.066	▲0.067	▲0.060	▲0.067
東京レポレート(ON)	▲0.120	▲0.105	▲0.225	▲0.089
無コール残	89,588	85,566	41,283	68,089
ON	64,758	61,361	28,623	46,979
その他	24,830	24,205	12,660	21,110
有コール残	12,230	15,576	9,883	27,518

日本		予想	海外		予想
8:50	日銀当座預金増減要因(4月見込み)	-	18:00	(欧)2月小売売上高[前月比]	0.1%
14:00	需給ギャップと潜在成長率	-	21:15	(米)3月ADP全米雇用報告	16.0万人
			23:00	(米)3月ISM非製造業景況指数	58.0

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	▲0.087
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.010	▲0.028	▲0.085
2W	▲0.070	0.000	▲0.034	▲0.089
3W	-	-	0.000	▲0.102
1M	-	-	-	▲0.125
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.135
6M	-	-	-	▲0.154
1Y	-	-	-	▲0.157

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.086%の出合から始まった。その後は主に▲0.086~▲0.025%の水準で取引された。同加重平均金利は前営業日と横ばいの▲0.067%となった。

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

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達姿勢は引き続き慎重で、本日と同様の軟調な地合いを予想する。

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 4月2日	日銀予想 4月3日	当社需給予想 4月4日
券	+500	+600	+0
財政	▲19,200	▲20,900	▲2,000
過不足	▲18,700	▲20,300	▲2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
CP等買入		▲100	
国債補充供給	+300	+100	
当座預金増減	▲18,500	▲20,300	▲2,000
当座預金残高	3,904,800	3,884,500	3,882,500
準備預金残高	3,411,900	主な需給要因	
積み終了先	3,411,700	消費税・法人税・保険揚げ 普通交付税 国債発行(10年)	国庫短期証券発行・償還(3M)
超過準備	3,411,700		
非準備先残高	492,900		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	58.1%		
乖離率	41.8%		

4月2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
米ドル資金供給(4/4~4/11)		0	0	2,910	2,910	
CP等買入(4/5~)	1,500	3,933	1,495	▲0.002	▲0.001	35.6
国債補充供給(4/2~4/3)	36,871	82	82	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]
4月1日時点 5,046,700

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,127,000
4月3日以降の残り所要積数	1,900
平均	200

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	第824回
4月9日	6ヶ月	
4月12日	3ヶ月	
国債入札予定		
4月2日	10年	
4月4日	30年	
4月9日	5年	
4月16日	20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	2			
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	3	12	19	24	3月25日	4
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	3	10	17	26	3月29日	4
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800						
25年超	100~1,000 程度	500	8	12	19	24	3月29日	4
物価連動債	250 程度	250	月2回程度		3月18日	2		
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。 上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登録)第243号 加入協会 日本証券業協会