

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年4月3日(水)

## 短期市場の推移

	3月28日	3月29日	4月1日	4月2日
加重平均金利	▲0.067	▲0.060	▲0.067	▲0.067
東京レポレート(ON)	▲0.105	▲0.225	▲0.089	▲0.087
無コール残	85,566	41,283	68,089	73,295
ON	61,361	28,623	46,979	49,385
その他	24,205	12,660	21,110	23,910
有コール残	15,576	9,883	27,518	27,291

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。

## 4月4日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
特になし		(米)新規失業保険申請件数[前週分]	-
-		(米)クリーブランド連銀総裁の講演	
-		-	

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	▲0.066	▲0.083
T/N	-	-	-	▲0.081
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.035	▲0.079
2W	▲0.045	▲0.010	▲0.030	▲0.085
3W	-	-	-	▲0.099
1M	-	-	-	▲0.123
2M	-	-	-	-
3M	-	-	▲0.030	▲0.133
6M	-	-	-	▲0.154
1Y	-	-	-	▲0.157

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▲0.086%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対比+0.001%の▲0.066%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.075	▲0.085 ~ ▲0.075	▲0.086 ~ ▲0.025

## 翌営業日のマーケット

本日と比べ調達ニーズがやや強くなり、出合いの水準は小幅上昇と予想する。

## 資金需給

	日銀速報 4月3日	日銀予想 4月4日	当社需給予想 4月5日
券	+600	▲400	+0
財政	▲19,300	▲700	▲1,000
過不足	▲18,700	▲1,100	▲1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+12,600
CP等買入	▲100		
国債補完供給	+100	+100	+1,500
当座預金増減	▲18,800	+11,600	+500
当座預金残高	3,886,000	3,897,600	3,898,100
準備預金残高	3,414,500	主な需給要因	
積み終了先	3,414,300	国庫短期証券発行・償還(3M)	
超過準備	3,414,300	国債発行(30年)	
非準預先残高	471,500		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	61.3%		
乖離率	38.6%		

## 4月3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(4/4~)						
1~3年	3,500	9,214	3,505	0.003	0.004	79.9
3~5年	4,000	11,794	4,008	0.002	0.003	6.5
5~10年	4,800	10,696	4,809	0.000	0.001	33.5
国債補完供給(4/3~4/4)						
20,162	40	40	▲0.600	▲0.600		
3,460	1	1	▲0.600	▲0.600		

マナタリーベース [億円]  
4月2日時点 5,027,700

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,127,000  
4月4日以降の残り所要積数 1,700  
平均 100

## 国庫短期証券入札予定

4月5日	3ヶ月	第824回
4月9日	6ヶ月	第825回
4月12日	3ヶ月	
4月18日	1年	
4月4日	30年	
4月9日	5年	
4月16日	20年	
4月23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	4月3日	3
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	3 10 17 26	4月3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	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。