

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年4月4日(木)

短期市場の推移

[億円][%]

4月5日の予定(時刻は日本時間)

	3月29日	4月1日	4月2日	4月3日
加重平均金利	▲0.066	▲0.067	▲0.067	▲0.068
東京レポレート(ON)	▲0.225	▲0.089	▲0.087	▲0.083
無コール残	41,283	68,089	73,295	76,114
ON	28,623	46,979	49,385	50,349
その他	12,660	21,110	23,910	25,765
有コール残	9,883	27,518	27,291	26,768

	日本	予想	海外	予想
10:00	日銀営業旬報告 (3月31日現在)	-	G7外相会合 (7日まで)	-
14:00頃	消費活動指数	-	(米)3月非農業部門 雇用者数	17.5万人
15:00	コール市場残高 (3月)	-	(米)3月失業率	3.8%

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	▲0.063	▲0.092
T/N	-	-	▲0.045	▲0.089
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.045	▲0.047	▲0.088
2W	-	-	-	▲0.091
3W	▲0.045	▲0.040	▲0.042	▲0.101
1M	-	-	▲0.040	▲0.127
2M	-	-	-	-
3M	-	-	▲0.033	▲0.134
6M	-	-	-	▲0.154
1Y	-	-	-	▲0.157

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.080%の出合から始まった。
その後は主に▲0.086~▲0.020%の水準で取引された。
同加重平均金利は前営業日対比+0.003%の▲0.063%となった。

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

翌営業日のマーケット

週末3日積みとなるため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。

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4日	日銀予想 4月5日	当社需給予想 4月8日
券	▲400	+200	+1,000
財政	+600	▲3,000	▲5,000
過不足	+200	▲2,800	▲4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+12,600		
共通担保(全店)			▲5,100
CP等買入		▲100	+1,500
ETF買入			+900
国債補完供給	+100	▲100	+100
当座預金増減	+12,800	▲400	▲9,100
当座預金残高	3,898,800	3,898,400	3,889,300
準備預金残高	3,435,600	主な需給要因	
積み終了先	3,435,400		
超過準備	3,435,400		
非準備預金残高	463,200	国債発行 (30年)	国庫短期証券 発行・償還 (3M)
準備預金進捗率	99.9%		
平均	64.5%		
乖離率	35.4%		

4月4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(4/4~4/5)						
	26,027	86	86	▲0.600	▲0.600	
	20,000	30	30	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]
4月3日時点 5,008,300

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,127,000
4月5日以降の残り所要積数	1,500
平均	100

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

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9日	5年	
4月16日	20年	
4月23日	2年	
5月8日	10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	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。