

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年4月5日(金)

短期市場の推移

[億円][%]

	4月1日	4月2日	4月3日	4月4日
加重平均金利	▲0.067	▲0.067	▲0.066	▲0.063
東京レポレート(ON)	▲0.089	▲0.087	▲0.083	▲0.092
無コール残	68,089	73,295	76,114	70,610
ON	46,979	49,385	50,349	44,375
その他	21,110	23,910	25,765	26,235
有コール残	27,518	27,291	26,768	23,499

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。無コール残は無担保・有担保コール残高の意。

4月8日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
9:30頃	【挨拶】黒田総裁(支店長会議)	-	15:00	(独)2月貿易収支
14:00	地域経済報告(4月)	-	15:00	(独)2月経常収支

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	▲0.150	0.001	▲0.063	▲0.094
T/N	-	-	-	▲0.094
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.032	▲0.039	▲0.093
2W	-	-	-	▲0.100
3W	-	-	-	▲0.118
1M	-	-	-	▲0.124
2M	-	-	-	-
3M	▲0.030	0.180	▲0.023	▲0.133
6M	-	-	-	▲0.153
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▲0.075%の出合から始まった。その後は主に▲0.080~▲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横ばいの▲0.063%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.075	▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.075 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

週明けは調達ニーズがやや高まり、出合の水準は小幅上昇と予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報 4月5日	日銀予想 4月8日	当社需給予想 4月9日
券	+200	+700	+1,000
財政	▲5,100	▲2,000	+0
過不足	▲4,900	▲1,300	+1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)	▲100	+1,500	+100
CP等買入	+900	+900	+100
ETF買入	+100	▲300	+300
国債補完供給			
当座預金増減	▲2,800	▲900	+1,000
当座預金残高	3,896,000	3,895,100	3,896,100
準備預金残高	3,424,600	主な需給要因	
積み終了先	3,424,400	国庫短期証券 発行・償還 (3M)	
超過準備	3,424,400		
非準備先残高	471,400		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	74.2%		
乖離率	25.7%		

4月5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(4/5~4/8)	31,108	330	330	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(4/8~4/22)	15,000	5,131	5,131			

マナタリーベース [億円]
4月4日時点 5,021,600

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,133,000
4月8日以降の残り所要積数 1,000
平均 100

国庫短期証券入札予定

4月9日	6ヶ月	第825回
4月12日	3ヶ月	第826回
4月18日	1年	
4月19日	3ヶ月	
4月9日	5年	
4月16日	20年	
4月23日	2年	
5月8日	10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。 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