

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年4月10日(水)

短期市場の推移

[億円][%]

	4月4日	4月5日	4月8日	4月9日
加重平均金利	▲0.063	▲0.063	▲0.063	▲0.064
東京レポレート(ON)	▲0.092	▲0.094	▲0.092	▲0.093
無コール残	70,610	79,939	74,558	75,878
ON	44,375	52,104	45,913	46,368
その他	26,235	27,835	28,645	29,510
有コール残	23,499	24,666	26,085	24,263

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11日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネーストック(3月)	-	21:30	(米)3月生産者物価コア指数[前年比] 2.5%
	-	-	21:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分]
	-	-	-	-

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	▲0.064	▲0.093
T/N	-	-	-	▲0.089
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.098
2W	-	-	▲0.020	▲0.105
3W	-	-	-	▲0.128
1M	-	-	▲0.035	▲0.132
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.137
6M	-	-	-	▲0.154
1Y	-	-	-	▲0.158

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▲0.08%の出合から始まり、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横ばいの▲0.064%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.075	▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.085 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

出合レンジは本日と概ね横ばい圏で推移すると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報 4月10日	日銀予想 4月11日	当社需給予想 4月12日
券	▲300	▲1,500	▲1,000
財政	▲18,300	+900	▲6,000
過不足	▲18,600	▲600	▲7,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+6,300
CP等買入	▲400	▲100	
ETF買入	+200	+100	
国債補完供給	+200		+1,500
当座預金増減	▲18,600	+5,700	▲5,500
当座預金残高	3,880,500	3,886,200	3,880,700
準備預金残高	3,417,100	主な需給要因	
積み終了先	3,417,000		
超過準備	3,417,000		
非準預先残高	463,400	源泉税揚げ	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	83.9%		
乖離率	16.0%		

4月10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(4/11~)						
5~10年	4,800	14,896	4,815	▲0.013	▲0.011	13.5
変動利付	1,000	2,702	1,003	▲0.160	▲0.163	75.5
物価連動	250	851	251	0.000	▲0.051	20.0
国債補完供給(4/10~4/11)						
	11,594	0	0			

マナタリーベース [億円]
4月9日時点 5,021,100

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,133,000
4月11日以降の残り所要積数 600
平均 100

国庫短期証券入札予定

4月12日	3ヶ月	第826回
4月18日	1年	
4月19日	3ヶ月	
5月8日	3ヶ月	
4月16日	20年	
4月23日	2年	
5月8日	10年	
5月10日	物価連動	

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	4月8日	1
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10日	2
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	100~1,000 程度	500	3 12 19 24	4月8日	3
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	4月10日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	4月10日	#VALUE!

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。