

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年4月12日(金)

短期市場の推移

[億円][%]

4月15日の予定(時刻は日本時間)

	4月8日	4月9日	4月10日	4月11日
加重平均金利	▲0.063	▲0.064	▲0.064	▲0.063
東京レポレート(ON)	▲0.092	▲0.093	▲0.093	▲0.107
無コール残	74,558	75,878	80,593	79,058
ON	45,913	46,368	50,718	49,163
その他	28,645	29,510	29,875	29,895
有コール残	26,085	24,263	22,595	22,957

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)4月NY連銀製造業景気指数	8.0
-	-	(米)シカゴ連銀総裁の講演	-
-	-	(米)ボストン連銀総裁の講演	-

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	▲0.062	▲0.130
T/N	-	-	-	▲0.137
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.001	▲0.137
2W	-	-	▲0.040	▲0.148
3W	-	-	-	▲0.149
1M	▲0.045	▲0.005	▲0.037	▲0.146
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.145
6M	-	-	-	▲0.154
1Y	-	-	-	▲0.158

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%~▲0.025%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▲0.062%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.086 ~ ▲0.020

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。

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12日	日銀予想 4月15日	当社需給予想 4月16日
券	▲1,300	▲700	+0
財政	▲9,600	+74,900	+1,000
過不足	▲10,900	+74,200	+1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+7,500	-	-
国債買入	-	+10,400	-
共通担保(全店)	-	+1,900	-
CP等買入	▲300	▲100	-
社債等買入	▲100	-	-
ETF買入	+100	+400	-
国債補充供給	▲100	+100	-
当座預金増減	▲2,300	+85,100	+1,000
当座預金残高	3,883,000	3,968,100	3,969,100
準備預金残高	3,397,800	主な需給要因	
積み終了先	3,397,700	-	-
超過準備	3,397,700	年金定時払い	-
非準預先残高	485,200	国債償還(2年)	-
準備預金進捗率	100.0%	国庫短期証券	-
平均	96.8%	発行・償還(3M)	-
乖離率	3.2%	-	-

4月12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(4/15~)						
1~3年	3,500	9,511	3,507	0.001	0.002	75.5
3~5年	4,000	7,536	4,005	0.000	0.001	75.6
10~25年	1,800	4,848	1,811	0.007	0.008	72.6
25年~	500	2,175	504	0.005	0.007	70.6
国債補充供給(4/12~4/15)	23,113	59	59	▲0.600	▲0.600	-
共通担保(全店)(4/15~4/26)	15,000	1,884	1,884	-	-	-

マナタリーベース [億円]
4月11日時点 5,009,000

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,133,000
4月15日以降の残り所要積数 0
平均 0

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

4月18日	1年	第827回
4月19日	3ヶ月	第828回
5月8日	3ヶ月	
5月9日	6ヶ月	
国債入札予定		
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	

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12日	2
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12日	2
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	0

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(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会