

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年4月23日(火)

短期市場の推移

[億円] [%]

	4月17日	4月18日	4月19日	4月22日
加重平均金利	▲0.065	▲0.069	▲0.072	▲0.076
東京レポレート(ON)	▲0.105	▲0.097	▲0.101	▲0.103
無コール残	63,684	71,536	84,805	75,763
ON	32,964	40,676	49,945	41,323
その他	30,720	30,860	34,860	34,440
有コール残	25,358	24,248	27,003	24,872

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24日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		20:00 (米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]	-

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

本日の市況

	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	▲0.077	▲0.106
T/N	-	-	-	▲0.113
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.050	▲0.149
2W	▲0.020	0.000	▲0.010	▲0.147
3W	▲0.025	0.001	▲0.020	▲0.135
1M	-	-	-	▲0.131
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.070	▲0.133
6M	-	-	-	▲0.154
1Y	-	-	-	▲0.158

本日の無担保コールON物は▲0.085%の出合から始まった。昨日に引き続き▲0.08%台での取引が中心となり、出合レンジは▲0.086%~▲0.045%であった。
同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.077%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.045

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの慎重な調達姿勢は継続と思われるため、地合に大きな変化はないと予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報 4月23日	日銀予想 4月24日	当社需給予想 4月25日
券	▲5,400	▲5,400	▲4,000
財政	+9,400	▲13,000	+11,000
過不足	+4,000	▲18,400	+7,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+5,000
CP等買入	▲100	▲300	
社債等買入	▲100		
ETF買入	+800	+700	
国債補完供給	+100		
当座預金増減	+4,700	▲13,000	+7,000
当座預金残高	3,990,200	3,977,200	3,984,200
準備預金残高	3,470,100	主な需給要因	
積み終了先	3,469,200		
超過準備	3,469,000		
非準備先残高	520,100	申告所得税揚	
準備預金進捗率	99.6%	げ	
平均	26.7%		
乖離率	73.0%		

4月23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
国庫短期証券買入(4/24~)	5,000	22,771	5,001	0.016	0.022	55.0
米ドル資金供給(4/25~5/9)			0	2.920	2.920	
CP等買入(4/26~)	1,500	4,115	1,485	▲0.002	0.001	77.9
国債補完供給(4/23~4/24)	23,639	3	3	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
4月22日時点 5,127,000	今積期の所要準備額 3,065,000
	4月24日以降の残り所要積数 11,600
	平均 500

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

5月8日	3ヶ月
5月9日	6ヶ月
5月10日	3ヶ月
5月16日	1年
5月8日	10年
5月10日	物価連動
5月14日	30年
5月16日	5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	4月17日	0
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19日	1
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	3 10 17 26	4月17日	1
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,600			
25年超	100~1,000 程度	400	8 12 19 24	4月19日	1
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	4月17日	0
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4月積み期 [4月16日~5月15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(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会