

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年3月18日(水)

短期市場の推移

	3月12日	3月13日	3月16日	3月17日
加重平均金利	▲0.066	▲0.067	▲0.068	▲0.068
東京レポレート(ON)	▲0.103	▲0.196	▲0.132	▲0.350
無コール残	100,660	116,160	98,338	102,748
ON	63,162	81,012	67,495	71,975
その他	37,498	35,148	30,843	30,773
有コール残	23,771	12,653	19,988	12,395

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。

3月19日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想	
8:30	2月消費者物価コア指数 [前年比]	+0.6%	21:30 (米)2月フィラデルフィア連 銀製造業景況指数	10.0
8:50	政策委員会・金融政策決定 会合議事要旨(1月20・ 21日分)	-	21:30 (米)新規失業保険申請件 数[前週分]	-
			21:30 (米)10-12月期経常収支	-1083億米ドル

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	▲0.087	0.001	▲0.063	▲0.199
T/N	▲0.060	▲0.040	▲0.051	▲0.218
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.222
2W	-	-	-	▲0.245
3W	-	-	-	▲0.257
1M	-	-	-	▲0.251
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.264
6M	-	-	-	▲0.256
1Y	-	-	-	▲0.253

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%の出合から始まり、その後は主に▲0.087~▲0.040%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比+0.003%の▲0.065%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.080	▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.080 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

引き続き調達意欲は底堅く、週末4日積みとなることで、出合の水準は本日よりも上昇する見込み。

資金需給

	日銀速報 3月18日	日銀予想 3月19日	当社需給予想 3月23日
券	▲600	▲1,200	+0
財政	▲1,200	+17,400	+100,000
過不足	▲1,800	+16,200	+100,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+2,200	+11,900	スタート
CP等買入	▲200	▲300	
社債等買入	▲200	▲1,600	
ETF買入	+300	+100	
国債補完供給	+7,500	+2,800	
米ドル供給用担保国債供給	▲11,900		
貸出増加支援	▲23,700	+41,500	
当座預金増減	+10,900	+29,100	+100,000
当座預金残高	3,910,200	3,939,300	4,039,300
準備預金残高	3,415,700	主な需給要因	
積み終了先	3,381,800	国庫短期証券 発行・償還(3M・ 1Y)	
超過準備	3,341,900	国債償還(5・10・ 20年・変動15年) 利払い	
非準備先残高	494,500		
準備預金進捗率	97.4%		
平均	9.7%		
乖離率	87.7%		

3月18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(3/19~)						
1~3年	4,200	7,330	4,202	0.008	0.012	89.9
3~5年	3,400	8,505	3,403	0.000	0.009	7.2
5~10年	3,500	7,925	3,502	0.015	0.020	17.2
物価連動	500	2,303	501	▲0.030	▲0.164	6.0
CP等買入(3/24~)	5,000	18,165	4,990	▲0.001	0.002	48.1
国債補完供給(3/18~3/19)						
	1,864	1,864	▲0.450	▲0.450		
	830	830	▲0.450	▲0.450		

マナタリーベース [億円]
3月17日時点 5,040,000

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,247,700
3月19日以降の残り所要
積数 83,700
平均 3,000

国庫短期証券入札予定

3月27日	3ヶ月
4月3日	3ヶ月
4月9日	6ヶ月
4月10日	3ヶ月
3月26日	40年
3月31日	2年
4月2日	10年
4月7日	30年

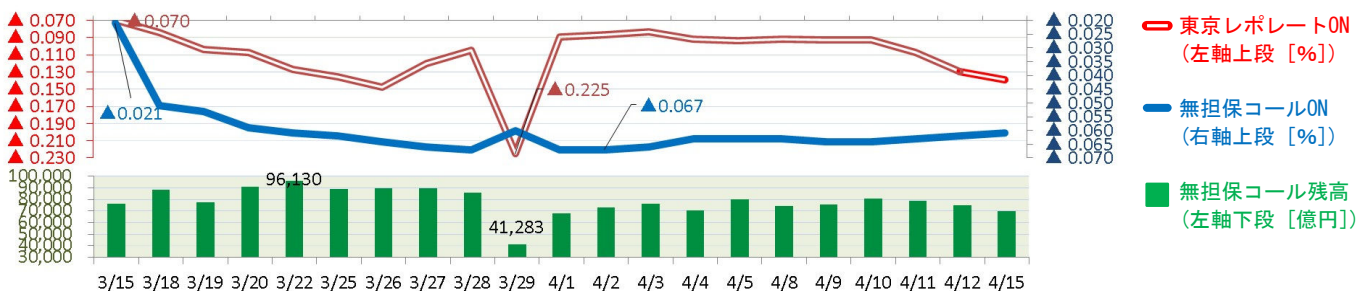
今月の国債買入オペ予定

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11日	0
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200			
3年超5年以下	1,000~4,500 程度	3,400	4 9 17 18 27	3月18日	1
5年超10年以下	1,000~5,000 程度	3,500	6 11 17 18 27	3月18日	1
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200			
25年超	0~500 程度	300	9 23	3月9日	1
物価連動債	300 程度	500	月2回程度	3月18日	0
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	2月13日	-

1年前の市場推移

○2019年3月積み期 [3月15日~4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(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会