

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年4月24日(金)

短期市場の推移

	4月20日	4月21日	4月22日	4月23日
加重平均金利	▲0.042	▲0.043	▲0.043	▲0.046
東京レポレート(ON)	▲0.101	▲0.116	▲0.113	▲0.105
無コール残	106,277	105,605	106,852	108,683
ON	70,959	71,137	70,554	70,695
その他	35,318	34,468	36,298	37,988
有コール残	16,756	14,434	15,742	16,017

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27日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
	日銀金融政策決定会合		(米)ダウ連銀製造業活動指数(4月)	
	展望レポート		-	
15:30	黒田日銀総裁、記者会見		-	

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	▲0.047	▲0.111
T/N	-	-	-	▲0.115
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.035	▲0.133
2W	-	-	▲0.015	▲0.133
3W	-	-	-	▲0.136
1M	-	-	-	▲0.141
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.146
6M	-	-	-	▲0.179
1Y	-	-	-	▲0.193

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▲0.045%の出合から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.020%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▲0.001%の▲0.047%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.055	▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.060 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの動向に変化はなく、本日と同様の地合になると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	4月24日	4月27日	4月27日	4月28日	4月28日	4月28日
券	▲1,800	▲1,800	▲1,800	▲1,000		
財政	+13,600	▲3,600	▲3,600	+8,000		
過不足	+11,800	▲5,400	▲5,400	+7,000		
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国債買入				+2,000		
共通担保(全店)			▲14,600	+13,400		
CP等買入	▲400		▲400			
社債等買入	▲400	+1,500				
ETF買入				+1,100		
国債補完供給	+100	▲500	+500			
米ドル資金供給用担保国債供給	+900					
新型コロナ企業金融支援特別				+200		
当座預金増減	+13,000	▲3,200	▲3,200	+7,000		
当座預金残高	4,110,200	4,107,000	4,107,000	4,114,000		
準備預金残高	3,552,700					
積み終了先	3,551,000					
超過準備	3,550,900					
非準備預金残高	557,500					
準備預金進捗率	99.7%					
平均	36.7%					
乖離率	63.0%					

4月24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(4/27~)						
10~25年	1,200	4,303	1,205	▲0.014	▲0.013	96.6
25年~	300	834	302	▲0.018	▲0.016	31.3
物価連動	300	1,548	300	▲0.110	▲0.214	
米ドル資金供給(4/28~5/7)						
CP等買入(4/30~)	6,000	14,100	6,000	0.052	0.081	94.7
国債補完供給(4/24~4/27)						
共通担保(全店)(4/27~5/11)	20,000	13,371	13,371			
新型コロナ企業金融支援特別(4/27~7/27)	178	178	178			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
4月23日時点 5,256,000	今積期の所要準備額 3,209,400
	4月27日以降の残り所要積数 9,200
	平均 500

国庫短期証券入札予定

5月1日	3ヶ月	第904回
5月7日	6ヶ月	
5月8日	3ヶ月	
5月15日	3ヶ月	
5月8日	物価連動	
5月12日	10年	
5月14日	30年	
5月18日	5年	

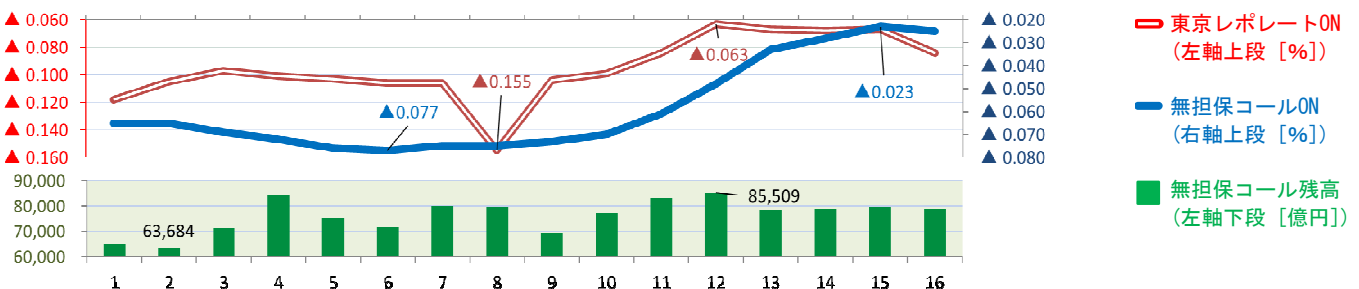
今月の国債買入オペ予定

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	500~1,000 程度	800	月3回程度	4月22日	1
1年超3年以下	2,000~4,500 程度	3,200	3 8 13 15 17 28	4月17日	1
3年超5年以下	1,500~4,000 程度	2,800	1 3 13 17 22 28	4月22日	1
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	6 8 13 22 28	4月22日	1
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200	3 24	4月24日	0
25年超	0~500 程度	300	3 24	4月24日	0
物価連動債	300 程度	300	月2回程度	4月24日	0
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	4月6日	0

1年前の市場推移

○2019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(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会