

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年5月7日(木)

短期市場の推移

	4月27日	4月28日	4月30日	5月1日
加重平均金利	▲0.047	▲0.048	▲0.060	▲0.044
東京レポレート(ON)	▲0.103	▲0.113	▲0.134	▲0.061
無コール残	105,822	109,417	112,350	112,381
ON	68,249	68,459	69,911	69,692
その他	37,573	40,958	42,439	42,689
有コール残	19,031	12,696	11,462	18,713

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。

5月8日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	日銀当座預金増減要因 (5月見込み)	-	21:30	(米)4月非農業部門雇用者数 -1900万人
	-		21:30	(米)4月失業率 -
	-			-

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	▲0.035	▲0.065
T/N	-	-	-	▲0.077
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.020	▲0.028	▲0.082
2W	-	-	▲0.030	▲0.085
3W	-	-	-	▲0.090
1M	▲0.001	0.010	0.005	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.122
6M	-	-	-	▲0.169
1Y	-	-	-	▲0.188

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▲0.050%の出合から始まり、その後は主に▲0.06%~▲0.020%の水準で出合が見られた。大手行を中心に資金調達ニーズが強く、同加重平均金利(速報)は、前営業日対比+0.009%の▲0.035%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.035	▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.040 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

本日同様、堅調な地合が継続すると予想する。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	5月7日	5月8日	5月11日
券	+2,800	+2,100	+1,000
財政	▲44,600	+3,000	▲40,000
過不足	▲41,800	+5,100	▲39,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+8,100	
共通担保(全店)			▲13,400
CP等買入	▲200		
ETF買入	+1,300	+800	
国債補完供給	+1,700	+3,100	
当座預金増減	▲42,100	+17,100	▲52,400
当座預金残高	4,048,500	4,065,600	4,013,200
準備預金残高	3,501,700	主な需給要因	
積み終了先	3,501,500		
超過準備	3,501,500		
非準備先残高	546,800		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	73.3%		
乖離率	26.6%		

5月7日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(5/8~)						
~1年	800	2,362	801	0.008	0.011	71.6
1~3年	3,400	6,864	3,404	0.010	0.014	43.6
5~10年	3,700	12,698	3,711	0.018	0.019	33.7
米ドル資金供給(5/11~5/18)						
400		400	0.300	0.300		
国債補完供給(5/7~5/8)						
3,003		3,003	▲0.350	▲0.357		
0		0				

マナタリーベース	所要
5月1日時点 5,261,500	今積期の所要準備額 3,209,400
	5月8日以降の残り所要積数 1,400
	平均 200

国庫短期証券入札予定

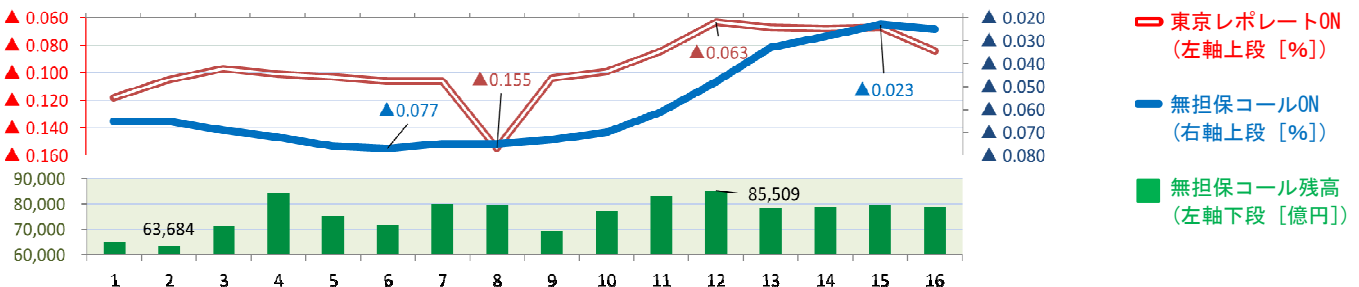
5月8日	3ヶ月	第906回
5月15日	3ヶ月	
5月19日	1年	
5月22日	3ヶ月	
5月8日	物価連動	
5月12日	10年	
5月14日	30年	
5月18日	5年	

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	800	月3回程度	5月7日	2
1年超3年以下	2,000~5,000	3,400	7 11 13 19 21 25	5月7日	5
3年超5年以下	2,000~5,000	3,000	11 13 21 25 29	4月28日	5
5年超10年以下	2,000~5,500	3,700	7 15 19 25 29	5月7日	4
10年超25年以下	500~2,000	1,200	13 29	4月24日	2
25年超	0~500	300	11 19	4月24日	2
物価連動債	300	300	月2回程度	4月24日	2
変動利付債<偶数月>	1,000	1,000	-	4月6日	-

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。