

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年5月14日(木)

短期市場の推移

	5月8日	5月11日	5月12日	5月13日
加重平均金利	▲0.027	▲0.019	▲0.022	▲0.026
東京レポレート(ON)	▲0.087	▲0.087	▲0.102	▲0.099
無コール残	107,859	95,169	106,955	107,149
ON	63,705	52,535	61,841	63,235
その他	44,154	42,634	45,114	43,914
有コール残	17,764	18,311	18,790	21,371

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15日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	4月国内企業物価指数 [前年比]	▲1.4%	18:00	(欧)1-3月期域内総生産 (GDP)改定値[前年比]	-
	-		21:30	(米)4月小売売上高	-10.9%
	-			-	

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	▲0.060	0.001	▲0.020	▲0.100
T/N	-	-	-	▲0.121
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.037	▲0.020	▲0.027	▲0.110
2W	-	-	▲0.035	▲0.111
3W	-	-	-	▲0.115
1M	▲0.030	▲0.020	▲0.026	▲0.120
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.128
6M	-	-	-	▲0.172
1Y	-	-	-	▲0.187

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券協会公表

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.025%の出合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.010%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+0.006%の▲0.020%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.015	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.030 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの動向に大きな変化はなく、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	
	5月14日	5月15日	5月14日	5月15日	5月18日	5月19日
券		+400		+900		+2,000
財政		+3,500		+37,500		▲19,000
過不足		+3,900		+38,400		▲17,000
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		+8,400				
CP等買入	▲200		▲700			+8,000
社債等買入		+3,000				
ETF買入		+1,200		+300		
被災地金融機関支援			▲300	+400		
国債補完供給	+100	▲200		+200		
米ドル資金供給用担保国債供給			+5,600			
新型コロナ対応金融支援特別				+86,800		
当座預金増減		+16,200		+130,700		▲9,000
当座預金残高		4,050,500		4,181,200		4,172,200
準備預金残高		3,513,800				
積み終了先		3,513,600				
超過準備		3,513,600				
非準備先残高		536,700				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		96.7%				
乖離率		3.2%				

5月14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
米ドル資金供給(5/18~5/26)		0	0	0.310	0.310	
国債補完供給(5/14~5/15)	194	194	▲0.350	▲0.350		
新型コロナ対応金融支援特別(5/15~8/14)	86,839	86,839				

マナタリーベース [億円]
5月13日時点 5,196,100

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,220,500
5月15日以降の残り所要積数 100
平均 100

国庫短期証券入札予定

5月15日	3ヶ月	第907回
5月19日	1年	第908回
5月22日	3ヶ月	
5月27日	6ヶ月	
5月18日	5年	
5月20日	20年	
5月26日	40年	
5月28日	2年	

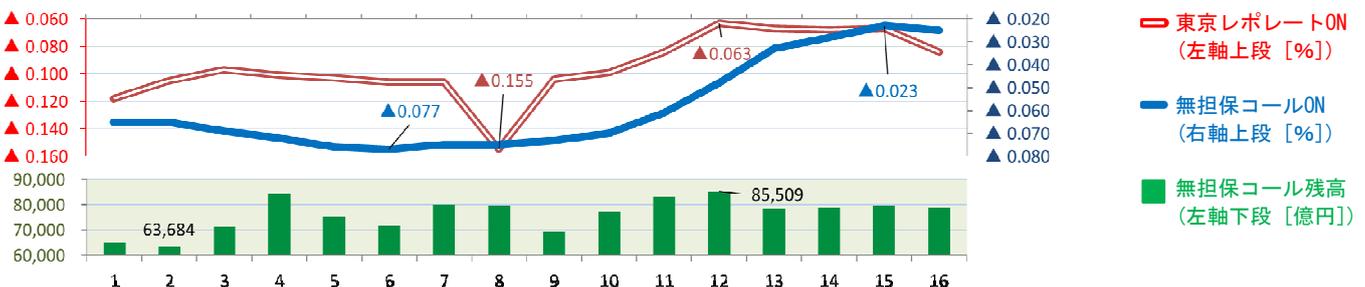
今月の国債買入オペ予定

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13日	3
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	11 13 21 25 29	5月13日	3
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	5月13日	1
25年超	0~500	300	11 19	5月11日	1
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。

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