

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年5月15日(金)

短期市場の推移

[億円] [%]

	5月11日	5月12日	5月13日	5月14日
加重平均金利	▲0.019	▲0.022	▲0.026	▲0.020
東京レポレート(ON)	▲0.087	▲0.102	▲0.099	▲0.100
無コール残	95,169	106,955	107,149	108,029
ON	52,535	61,841	63,235	65,185
その他	42,634	45,114	43,914	42,844
有コール残	18,311	18,790	21,371	19,313

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。

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	▲0.080	0.001	▲0.040	▲0.096
T/N	▲0.087	▲0.080	▲0.082	▲0.092
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.200	0.009	▲0.096
2W	▲0.040	▲0.030	▲0.038	▲0.100
3W	-	-	-	▲0.106
1M	▲0.060	▲0.045	▲0.053	▲0.112
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.125
6M	-	-	-	▲0.169
1Y	-	-	-	▲0.183

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

5月18日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	1-3月期国内総生産(GDP)速報値[前期比年率]	▲4.5%	-	-
17:00	業態別の日銀当座預金残高(4月)	-	-	-
	-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.040%の出合から始まり、その後は主に▲0.060%～▲0.015%の水準で出合が見られた。本日は積み最終日であるものの、ON物が来積みにかかることからビットサイドの調達意欲が減退し、同加重平均金利(速報)は、前営業日対比▲0.020%の▲0.040%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.040	▲0.035 ~ ▲0.035	▲0.040 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

積み期序盤から資金を取り急ぐ動きが限定的と思われ、地合いは弱含むと予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	5月15日	5月18日	5月19日
券	+1,000	+1,300	+2,000
財政	+38,900	▲25,700	▲37,000
過不足	+39,900	▲24,400	▲35,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+4,600	
CP等買入	▲700	+8,000	
ETF買入		+2,500	
被災地金融機関支援	▲300		
国債補完供給	+200	+700	
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	+131,500	▲9,000	▲35,000
当座預金残高	4,182,000	4,173,000	4,138,000
準備預金残高	3,629,700	主な需給要因	
積み終了先	3,629,700	国庫短期証券発行・償還(3M)	
超過準備	3,629,600		
非準備先残高	552,300		
準備預金進捗率	100.0%	国債発行(5年)申告所得税場	
平均	100.0%		
乖離率	0.0%		

5月15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 按分

国債買入(5/18~)						
~1年	800	2,527	801	0.003	0.006	93.2
5~10年	3,700	8,169	3,708	0.001	0.002	68.3

米ドル資金供給(5/19~5/26)

	0	0	0.300	0.300
--	---	---	-------	-------

国債補完供給(5/15~5/18)

	670	670	▲0.350	▲0.350
--	-----	-----	--------	--------

	0	0		
--	---	---	--	--

マネタリーベース[億円]
5月14日時点 5,212,000

所要	[億円]
来積み期の所要準備額	3,360,900
5月18日以降の残り所要	
積数	101,300
平均	3,500

国庫短期証券入札予定

5月19日	1年	第908回
5月22日	3ヶ月	第909回
5月27日	6ヶ月	
5月29日	3ヶ月	

国債入札予定

5月18日	5年
5月20日	20年
5月26日	40年
5月28日	2年

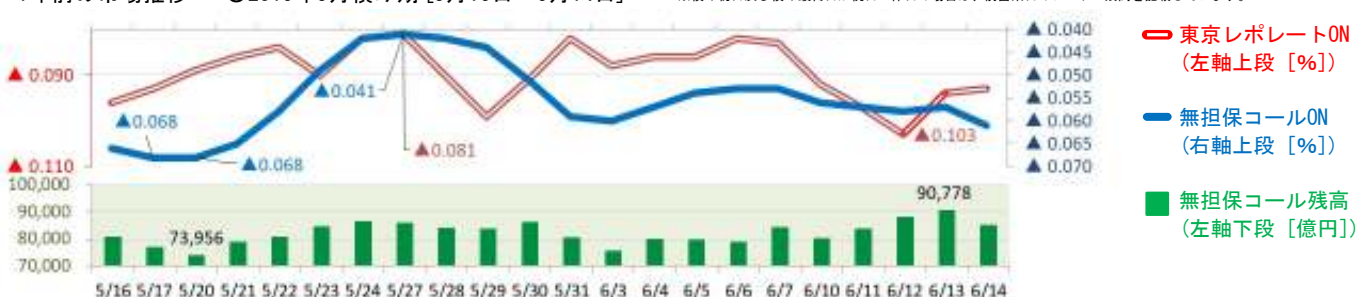
今月の国債買入オペ予定

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15日	1
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15日	3
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5月積み期 [5月16日~6月14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(登名)第243号 加入協会 日本証券業協会