

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年5月20日(水)

短期市場の推移

	5月14日	5月15日	5月18日	5月19日
加重平均金利	▲0.020	▲0.040	▲0.058	▲0.061
東京レポレート(ON)	▲0.100	▲0.096	▲0.124	▲0.125
無コール残	108,029	109,241	113,323	115,269
ON	65,185	70,307	69,164	68,130
その他	42,844	38,934	44,159	47,139
有コール残	19,313	18,496	16,306	17,370

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21日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想	
8:50	4月貿易収支	-4089億円	21:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分]	-
-	-	-	22:45	(米)5月製造業購買部担当者指数(PMI)	37.8
-	-	-	22:45	(米)5月サービス業購買部担当者指数(PMI)	32.5

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	▲0.061	▲0.104
T/N	-	-	▲0.080	▲0.115
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	0.001	▲0.014	▲0.118
2W	▲0.030	0.310	0.048	▲0.121
3W	-	-	-	▲0.122
1M	-	-	▲0.048	▲0.123
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.129
6M	-	-	-	▲0.168
1Y	-	-	-	▲0.181

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▲0.065%の出合から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.040%の水準で出合が見られた。引き続きビッドサイドは慎重な調達姿勢となり、同加重平均金利(速報)は、前営業日対比横ばいの▲0.061%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.065	▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.080 ~ ▲0.040

翌営業日のマーケット

引き続き軟調な地合が継続すると予想。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	5月20日	5月21日	5月22日
券	+200	▲300	▲1,000
財政	+33,400	▲14,100	+7,000
過不足	+33,600	▲14,400	+6,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+7,900		
CP等買入	▲400	▲200	
社債等買入		▲100	
ETF買入	+900		
国債補完供給	+300	+100	
米ドル資金供給用担保国債供給	▲100		
当座預金増減	+42,100	▲14,600	+6,000
当座預金残高	4,181,200	4,166,600	4,172,600
準備預金残高	3,578,300	主な需給要因	
積み終了先	3,572,100		
超過準備	3,569,300		
非準備先残高	602,900	国債発行(20年)	
準備預金進捗率	99.3%		
平均	16.1%		
乖離率	83.2%		

5月20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(5/22~5/29)		0	0	0.310	0.310	
国債補完供給(5/20~5/21)	105	105	▲0.350	▲0.350		
社債等買入(5/26~)	3~5年	2,000	5,920	2,001	0.170	0.212
					0.212	31.6

マネタリーベース [億円]
5月19日時点 5,297,800

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,360,900
5月21日以降の残り所要積数 23,500
平均 900

国庫短期証券入札予定

5月22日	3ヶ月	第909回
5月27日	6ヶ月	第910回
5月29日	3ヶ月	
6月5日	3ヶ月	
5月26日	40年	
5月28日	2年	
6月2日	10年	
6月4日	30年	

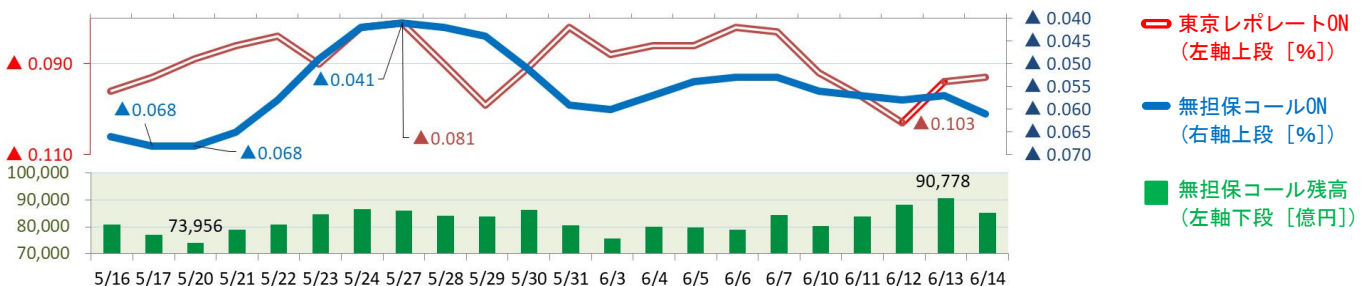
今月の国債買入オペ予定

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	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19日	2
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19日	2
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19日	0
物価連動債	300	300	月2回程度	5月19日	1
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。