

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年5月22日(金)

短期市場の推移

	5月18日	5月19日	5月20日	5月21日
加重平均金利	▲0.058	▲0.061	▲0.061	▲0.062
東京レポレート(ON)	▲0.124	▲0.125	▲0.104	▲0.101
無コール残	113,323	115,269	115,375	111,576
ON	69,164	68,130	66,256	68,277
その他	44,159	47,139	49,119	43,299
有コール残	16,306	17,370	19,263	20,137

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25日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)休場 (メモリアル・デー)	-
-	-	17:00 (独)5月IFO企業景況感 指数	78.3
-	-	-	-

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	▲0.059	▲0.093
T/N	-	-	▲0.080	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	0.200	▲0.057	▲0.093
2W	-	-	▲0.065	▲0.098
3W	-	-	▲0.050	▲0.104
1M	▲0.050	▲0.005	▲0.037	▲0.108
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.123
6M	-	-	-	▲0.168
1Y	-	-	-	▲0.184

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▲0.060%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。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比+0.003%の▲0.059%となった。日銀は臨時金融政策決定会合で、企業等の資金繰り支援のための措置として、新たな資金供給手段の内容を決定した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.055	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.080 ~ ▲0.040

翌営業日のマーケット

週初となることで、出合水準は若干低下する見込み。

資金需給

	日銀速報 5月22日	日銀予想 5月25日	当社需給予想 5月26日
券	▲200	+100	+1,000
財政	+32,300	▲38,500	+9,000
過不足	+32,100	▲38,400	+10,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+15,000	-	-
国債買入	+7,800	-	-
共通担保(全店)	-	▲8,500	+4,000
CP等買入	▲200	▲600	-
社債等買入	-	▲100	+2,000
ETF買入	+1,700	-	-
国債補充供給	▲100	+100	-
当座預金増減	+56,300	▲43,500	+12,000
当座預金残高	4,223,200	4,179,700	4,191,700
準備預金残高	3,639,900	主な需給要因	
積み終了先	3,637,900	-	-
超過準備	3,636,900	-	-
非準備預金残高	583,300	国庫短期証券 発行・償還(3M)	-
準備預金進捗率	99.7%	-	-
平均	29.0%	-	-
乖離率	70.7%	-	-

5月22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(5/27~6/3)	164	164	0.300	0.300	-	-
国債補充供給(5/22~5/25)	114	114	▲0.350	▲0.350	-	-
0	0	0	-	-	-	-
共通担保(全店)(5/25~6/15)	20,000	3,961	3,961	-	-	-

マナタリーベース [億円]
5月21日時点 5,325,700

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,360,900
5月25日以降の残り所要
積数 10,600
平均 500

国庫短期証券入札予定

5月27日	6ヶ月	第910回
5月29日	3ヶ月	第911回
6月5日	3ヶ月	
6月9日	6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	

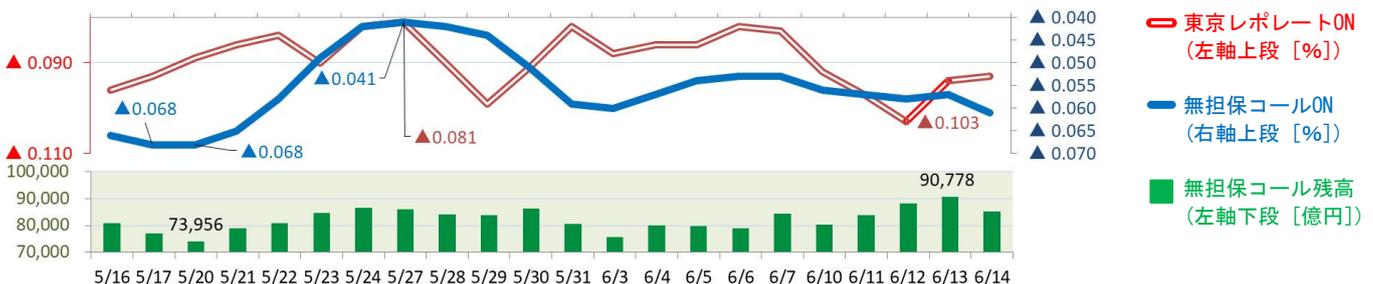
今月の国債買入オペ予定

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21日	1
1年超3年以下	2,000~5,000	3,400	7 11 13 19 21 25	5月21日	1
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	11 13 21 25 29	5月21日	2
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。