

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年5月27日(水)

短期市場の推移

	5月21日	5月22日	5月25日	5月26日
加重平均金利	▲0.062	▲0.059	▲0.059	▲0.060
東京レポレート(ON)	▲0.101	▲0.093	▲0.070	▲0.081
無コール残	111,576	115,475	116,885	119,629
ON	68,277	70,076	70,456	72,680
その他	43,299	45,399	46,429	46,949
有コール残	20,137	19,090	20,069	17,953

5月28日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)1-3月期国内総生産(GDP)改定値[前期比年率]	-4.8%
-	-	(米)新規失業保険申請件数[前週分]	-
-	-	-	-

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。

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	▲0.089
T/N	-	-	▲0.080	▲0.099
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.080	▲0.001	▲0.015	▲0.099
2W	-	-	▲0.065	▲0.101
3W	-	-	-	▲0.103
1M	-	-	▲0.065	▲0.109
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.123
6M	-	-	-	▲0.166
1Y	-	-	-	▲0.187

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%~▲0.045%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+0.001%の▲0.059%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.055	▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.070 ~ ▲0.045

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。

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

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	5月27日	5月28日	5月29日
券	▲600	▲1,500	▲100
財政	▲1,500	+14,900	▲2,800
過不足	▲2,100	+13,400	▲2,900
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+20,000		
CP等買入	▲200	▲600	+8,000
社債等買入		▲100	
ETF買入		+600	
国債補完供給	+200		
米ドル資金供給用担保国債供給		▲1,000	
新型コロナ対応金融支援特別	+17,300		
当座預金増減	+35,200	+12,300	+5,100
当座預金残高	4,242,000	4,254,300	4,259,400
準備預金残高	3,648,500	主な需給要因	
積み終了先	3,647,200		
超過準備	3,647,200		
非準備預金残高	593,500		
準備預金進捗率	99.8%		
平均	38.7%		
乖離率	61.1%		

5月27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(5/29~6/5)	0	0	0	0.300	0.300	
米ドル資金供給(5/29~8/20)	1,501	1,501	0	0.300	0.300	
国債補完供給(5/27~5/28)	0	0	0			
米ドル資金供給用担保国債供給(5/28~8/21)	5,000	945	945	▲0.100	▲0.100	

マナタリーベース [億円]
5月26日時点 5,366,700

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,360,900
5月28日以降の残り所要積数 6,200
平均 300

国庫短期証券入札予定

5月29日	3ヶ月	第911回
6月5日	3ヶ月	
6月9日	6ヶ月	
6月12日	3ヶ月	
5月28日	2年	
6月2日	10年	
6月4日	30年	
6月18日	5年	

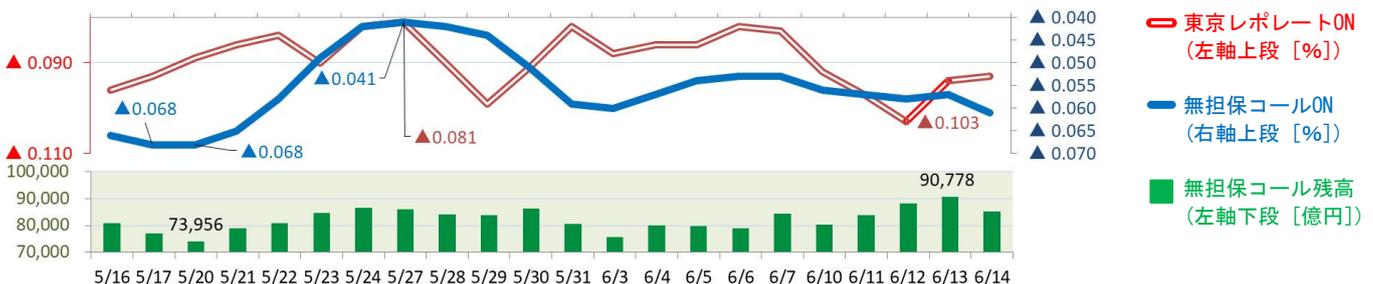
今月の国債買入オペ予定

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21日	1
1年超3年以下	2,000~5,000	3,400	7/11/13/19/21/25	5月25日	0
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	11/13/21/25/29	5月25日	1
5年超10年以下	2,000~5,500	3,700	7/15/19/25/29	5月25日	1
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25日	0
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