

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年5月28日(木)

## 短期市場の推移

	5月22日	5月25日	5月26日	5月27日
加重平均金利	▲0.059	▲0.059	▲0.060	▲0.059
東京レポレート(ON)	▲0.093	▲0.070	▲0.081	▲0.089
無コール残	115,475	116,885	119,629	122,911
ON	70,076	70,456	72,680	74,652
その他	45,399	46,429	46,949	48,259
有コール残	19,090	20,069	17,953	20,663

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29日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想	
8:30	4月有効求人倍率	1.31倍	18:00	(欧)5月消費者物価コア指数[前年比]	-
8:30	4月失業率	+2.7%	21:30	(米)4月個人消費支出	-12.6%
8:50	4月鉱工業生産指数[前月比]	▲5.4%	-	-	-

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	▲0.057	▲0.110
T/N	▲0.150	▲0.080	▲0.114	▲0.113
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.080	▲0.065	▲0.076	▲0.104
2W	-	-	▲0.070	▲0.104
3W	-	-	▲0.075	▲0.105
1M	▲0.065	0.060	▲0.023	▲0.109
2M	-	-	0.030	-
3M	-	-	-	▲0.124
6M	-	-	-	▲0.164
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業協会公表

## 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.055%の出合から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.05%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+0.002%の▲0.057%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.050	- ~ -	▲0.065 ~ ▲0.050

## 翌営業日のマーケット

月末のため調達を控える先もあると想定され、出合の水準はやや低下すると予想。

## 資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	5月28日	5月29日	6月1日
券	▲1,500	▲900	+1,000
財政	+13,000	+14,100	▲68,000
過不足	+11,500	+13,200	▲67,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲600	▲2,100	+8,000
社債等買入	▲100	-	-
ETF買入	+600	-	-
国債補完供給	▲300	+300	-
米ドル資金供給用担保国債供給	▲1,000	-	-
当座預金増減	+10,100	+19,400	▲67,000
当座預金残高	4,252,100	4,271,500	4,204,500
準備預金残高	3,660,100	主な需給要因	
積み終了先	3,659,400	国債発行・償還(2年)	
超過準備	3,658,900	国庫短期証券発行(3M・6M)	
非準預先残高	592,000	国庫短期証券償還(6M)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	41.9%		
乖離率	57.9%		

## 5月28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(6/1~6/8)		0	0	0.300	0.300	
国債補完供給(5/28~5/29)	321	321	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]  
5月27日時点 5,402,500

所要	所要準備額
今積期の所要準備額	3,360,900
5月29日以降の残り所要積数	5,000
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	
6月2日	10年	
6月4日	30年	
6月18日	5年	
6月25日	20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