

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年5月11日(月)

短期市場の推移

	4月30日	5月1日	5月7日	5月8日
加重平均金利	▲0.060	▲0.044	▲0.035	▲0.027
東京レポレート(ON)	▲0.134	▲0.061	▲0.065	▲0.087
無コール残	112,350	112,381	113,551	107,859
ON	69,911	69,692	68,177	63,705
その他	42,439	42,689	45,374	44,154
有コール残	11,462	18,713	17,870	17,764

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12日の予定(時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
8:50	マナターベースと日本銀行の取引(4月)	-	(米)4月消費者物価コア指数[前年比]	-
10:00	営業毎旬報告(5月10日現在)	-	-	-
15:00	コール市場残高(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	▲0.070	0.001	▲0.019	▲0.087
T/N	-	-	-	▲0.111
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.015	▲0.100
2W	-	-	-	▲0.102
3W	-	-	-	▲0.105
1M	-	-	-	▲0.110
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.124
6M	-	-	-	▲0.166
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▲0.020%の出合から始まり、その後は主に▲0.025%~▲0.010%の水準で出合が見られた。幅広い業態で資金調達ニーズが根強く、同加重平均金利(速報)は、前営業日対比+0.008%の▲0.019%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.020 ~ ▲0.015	▲0.020 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

引き続き強い地合が継続すると予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月11日	5月12日	5月12日	5月13日	5月13日	5月13日
券		+1,700	+1,600	+1,000	+1,000	
財政		▲37,400	+15,600	▲26,000	▲26,000	
過不足		▲35,700	+17,200	▲25,000	▲25,000	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国債買入				+7,300		
共通担保(全店)	▲13,400	+8,500				
CP等買入	▲200		▲500			
ETF買入				+800		
国債補完供給	+200	▲800	+800			
当座預金増減		▲41,400	+25,600	▲25,000		
当座預金残高		4,022,300	4,047,900	4,022,900		
準備預金残高		3,483,700				
積み終了先		3,483,500				
超過準備		3,483,500				
非準預先残高		538,600				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		86.7%				
乖離率		13.2%				

5月11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
国債買入(5/12~)						
1~3年	3,400	6,851	3,402	▲0.005	▲0.001	14.7
3~5年	3,500	9,837	3,506	0.015	0.017	16.8
25年~	300	1,360	307	0.018	0.019	74.8
米ドル資金供給(5/13~5/20)						
		86	86	0.300	0.300	
国債補完供給(5/11~5/12)						
	715	715	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナターベース [億円]	所要 [億円]
5月8日時点 5,229,800	今積期の所要準備額 3,220,500
	5月12日以降の残り所要積数 800
	平均 200

国庫短期証券入札予定

5月15日	3ヶ月	第907回
5月19日	1年	
5月22日	3ヶ月	
5月27日	6ヶ月	
5月12日	10年	
5月14日	30年	
5月18日	5年	
5月20日	20年	

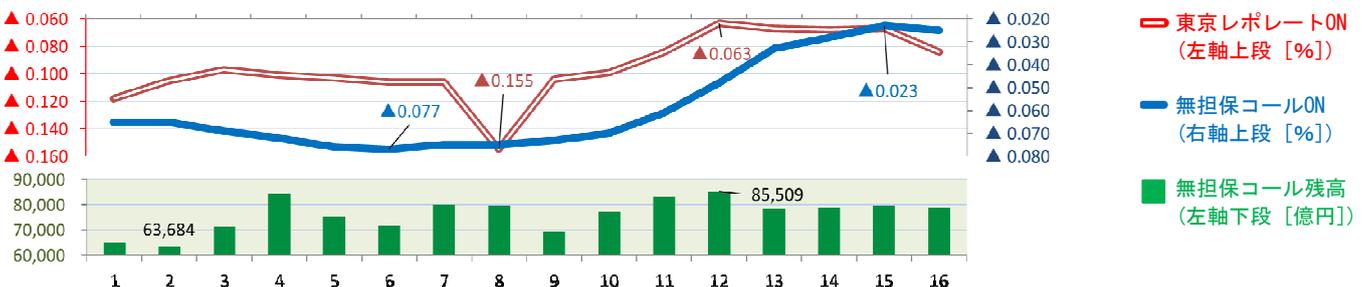
今月の国債買入オペ予定

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7日	2
1年超3年以下	2,000~5,000	3,400	7 11 13 19 21 25	5月11日	4
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	11 13 21 25 29	5月11日	4
5年超10年以下	2,000~5,500	3,700	7 15 19 25 29	5月7日	4
10年超25年以下	500~2,000	1,200	13 29	4月24日	2
25年超	0~500	300	11 19	5月11日	1
物価運動債	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4月積み期 [4月16日~5月15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(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会