

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年5月18日(月)

短期市場の推移

	5月12日	5月13日	5月14日	5月15日
加重平均金利	▲0.022	▲0.026	▲0.020	▲0.040
東京レポレート(ON)	▲0.102	▲0.099	▲0.100	▲0.096
無コール残	106,955	107,149	108,029	109,241
ON	61,841	63,235	65,185	70,307
その他	45,114	43,914	42,844	38,934
有コール残	18,790	21,371	19,313	18,496

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19日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
13:30	鉱工業生産・確報(3月)	21:30	(米)4月住宅着工件数 95万戸
			(米)財務長官とFRB議長が議会証言(上院)

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	▲0.085	0.001	▲0.058	▲0.124
T/N	▲0.087	▲0.080	▲0.082	▲0.138
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	0.010	▲0.024	▲0.125
2W	▲0.050	0.050	▲0.024	▲0.128
3W	-	-	-	▲0.125
1M	▲0.060	▲0.001	▲0.038	▲0.124
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.131
6M	-	-	-	▲0.169
1Y	-	-	-	▲0.182

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%の合から始まり、その後は主に▲0.070%~▲0.030%の水準で出合が見られた。積み初日ということもあり、ビッドサイドの動きは慎重になり、同加重平均金利(速報)は、前営業日対比▲0.018%の▲0.058%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.060	▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.070 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

引き続き、ビッドサイドは慎重な動きとなろう。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月18日	5月19日	5月19日	5月20日	5月20日	5月21日
券	+1,100	+800	+800	+1,000	+1,000	+1,000
財政	▲24,700	▲33,600	▲33,600	+19,000	+19,000	+19,000
過不足	▲23,600	▲32,800	▲32,800	+20,000	+20,000	+20,000
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		+4,600				
CP等買入	▲400	+8,000	▲300			
ETF買入		+2,500		+100		
国債補完供給	+700	▲1,000	+1,000			
当座預金増減	▲9,200	▲32,000	▲32,000	+20,000	+20,000	+20,000
当座預金残高	4,172,800	4,140,800	4,140,800	4,160,800	4,160,800	4,160,800
準備預金残高	3,598,300					
積み終了先	3,568,000					
超過準備	3,549,200					
非準備先残高	574,500					
準備預金進捗率	98.4%					
平均	9.7%					
乖離率	88.8%					

5月18日のオペ結果

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(5/20~5/27)	118	118	0.300	0.300		
国債補完供給(5/18~5/19)	962	962	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

国庫短期証券入札予定

5月19日	1年	第908回
5月22日	3ヶ月	第909回
5月27日	6ヶ月	
5月29日	3ヶ月	
5月20日	20年	
5月26日	40年	
5月28日	2年	
6月2日	10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13日	3
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15日	3
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11日	1
物価連動債	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	-

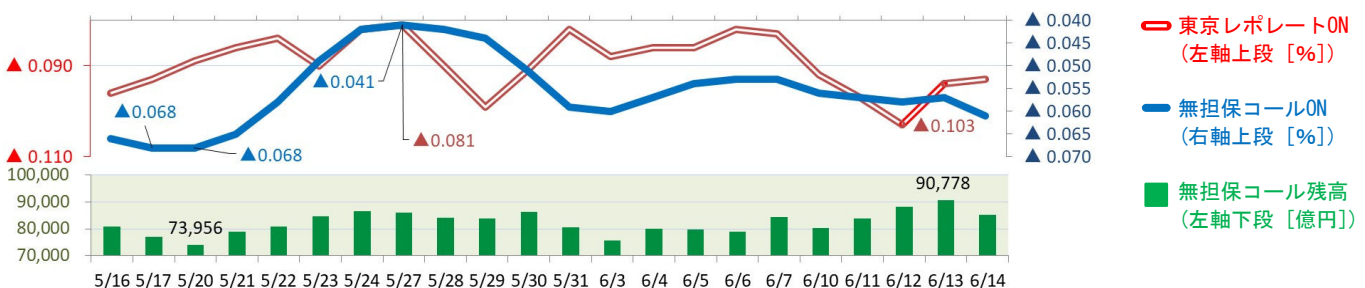
マナタリーベース [億円]
5月15日時点 5,342,500

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,360,900
5月19日以降の残り所要積数 52,100
平均 1,900

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