

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年5月26日(火)

短期市場の推移

	5月20日	5月21日	5月22日	5月25日
加重平均金利	▲0.061	▲0.062	▲0.059	▲0.059
東京レポレート(ON)	▲0.104	▲0.101	▲0.093	▲0.070
無コール残	115,375	111,576	115,475	116,885
ON	66,256	68,277	70,076	70,456
その他	49,119	43,299	45,399	46,429
有コール残	19,263	20,137	19,090	20,069

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27日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)ペー・ジュブツク	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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	▲0.060	▲0.081
T/N	-	-	▲0.080	▲0.092
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	0.010	▲0.041	▲0.095
2W	-	-	▲0.065	▲0.097
3W	-	-	-	▲0.104
1M	▲0.060	▲0.050	▲0.053	▲0.109
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.122
6M	-	-	-	▲0.171
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▲0.060%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▲0.060%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.060	▲0.070 ~ ▲0.065	▲0.070 ~ ▲0.045

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26日	5月27日	5月27日	5月28日	5月28日	5月29日
券	▲800	▲600	▲600	▲600	+0	+0
財政	+14,500	▲1,800	▲1,800	▲1,000	▲1,000	▲1,000
過不足	+13,700	▲2,400	▲2,400	▲1,000	▲1,000	▲1,000
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
国庫短期証券買入				+20,000		
国債買入		+11,100				
CP等買入	▲800		▲200			
社債等買入	▲300	+2,000				
ETF買入		+300				
国債補完供給	+300	▲200	+200			
新型コロナ対応金融支援特別				+17,300		
当座預金増減	+26,100	+34,900	+34,900	▲1,000	▲1,000	▲1,000
当座預金残高	4,206,800	4,241,700	4,241,700	4,240,700	4,240,700	4,240,700
準備預金残高	3,628,600	3,627,000	3,627,000	3,627,000	3,627,000	3,627,000
積み終了先	3,627,000	3,627,000	3,627,000	3,627,000	3,627,000	3,627,000
超過準備	3,627,000	3,627,000	3,627,000	3,627,000	3,627,000	3,627,000
非準備先残高	578,200	578,200	578,200	578,200	578,200	578,200
準備預金進捗率	99.8%	99.8%	99.8%	99.8%	99.8%	99.8%
平均	35.5%	35.5%	35.5%	35.5%	35.5%	35.5%
乖離率	64.3%	64.3%	64.3%	64.3%	64.3%	64.3%

5月26日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国庫短期証券買入(5/27~)	20,000	41,709	20,004	0.000	0.003	35.2
米ドル資金供給(5/28~6/4)		5,250	5,250	0.300	0.300	
CP等買入(5/29~)	8,000	19,452	8,000	▲0.027	▲0.020	87.3
国債補完供給(5/26~5/27)	141	141	▲0.350	▲0.350		
新型コロナ対応金融支援特別(5/27~8/27)	17,292	17,292				

マナタリーベース [億円]
5月25日時点 5,339,800

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,360,900
5月27日以降の残り所要積数 7,600
平均 400

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	

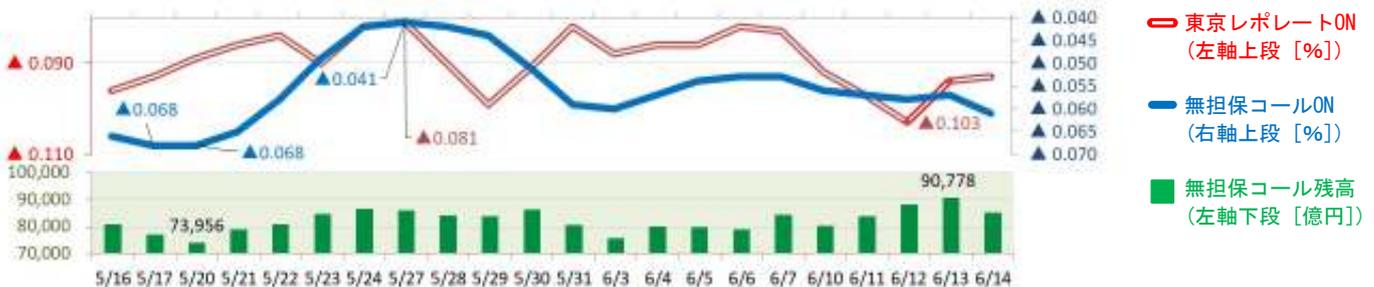
今月の国債買入オペ予定

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。