

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

令和1年5月13日(月)

短期市場の推移

[億円][%]

5月14日の予定(時刻は日本時間)

	5月7日	5月8日	5月9日	5月10日
加重平均金利	▲0.070	▲0.061	▲0.048	▲0.033
東京レポレート(ON)	▲0.099	▲0.084	▲0.063	▲0.067
無コール残	77,287	83,182	85,509	78,459
ON	43,927	50,303	51,100	47,055
その他	33,360	32,879	34,409	31,404
有コール残	26,938	23,850	24,951	22,164

	日本	予想	海外	予想	
8:50	3月国際収支(経常収支)	29,797億円	18:00	(欧)3月鉱工業生産指数[前月比]	-0.4%
10:00	日銀営業毎旬報告(5月10日現在)	-		(米)輸出入物価(4月)	
				(米)NY連銀総裁講演	

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	▲0.080	0.001	▲0.028	▲0.068
T/N	-	-	-	▲0.060
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.083
2W	▲0.020	0.000	▲0.013	▲0.098
3W	▲0.025	0.001	▲0.024	▲0.105
1M	-	-	▲0.015	▲0.117
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.130
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.157

本日の市況

本日の無担保コールON物は、▲0.030%の出合から始まった。その後は主に▲0.045%~▲0.025%の水準で取引された。先週末より調達ニーズは強まり、同加重平均金利は前営業日対比+0.005%の▲0.028%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.045 ~ ▲0.025		▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.045 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

引き続き資金調達ニーズは旺盛と思われるため、堅調な地合を予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月13日	5月14日	5月14日	5月15日	5月15日	5月16日
券	+4,000	+3,100	+3,100	+4,000	+4,000	+4,000
財政	▲3,100	▲900	▲900	▲1,000	▲1,000	▲1,000
過不足	+900	+2,200	+2,200	+3,000	+3,000	+3,000
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				+7,600		
共通担保(全店)	▲4,100	+3,000				
CP等買入	▲100					
国債補完供給	+200	▲1,800	+1,800			
当座預金増減	▲1,900	+11,600	+11,600	+3,000	+3,000	+3,000
当座預金残高	3,943,900	3,955,500	3,955,500	3,958,500	3,958,500	3,958,500
準備預金残高	3,485,200	主な需給要因				
積み終了先	3,484,900	源泉税揚げ				
超過準備	3,484,900	国債償還(2年)				
非準備先残高	458,700	国債発行(30年)				
準備預金進捗率	99.9%					
平均	93.3%					
乖離率	6.6%					

5月13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(5/14~)						
1~3年	3,500	12,802	3,504	▲0.001	0.000	67.2
3~5年	4,000	18,315	4,011	0.001	0.001	80.4
国債補完供給(5/13~5/14)						
180,963	1,636	1,636	▲0.500	▲0.500		
9,900	69	69	▲0.500	▲0.500		

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
5月10日時点 5,087,600	今積期の所要準備額 3,084,800
	5月14日以降の残り所要積数 200
	平均 100

国庫短期証券入札予定

5月16日	1年	第832回
5月17日	3ヶ月	第833回
5月24日	3ヶ月	
5月31日	3ヶ月	
国債入札予定		
5月14日	30年	
5月16日	5年	
5月22日	20年	
5月28日	40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	100~1,000 程度	500	月2回程度	5月9日	1
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	7 13 21 27	5月13日	2
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	9 15 21 31	5月9日	3
10年超25年以下	1,000~2,500 程度	1,600			
25年超	100~1,000 程度	400	7 17 27 31	5月7日	3
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	4月17日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	4月10日	-

1年前の市場推移

○2018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(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会