

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

令和1年5月14日(火)

短期市場の推移

[億円][%]

5月15日の予定(時刻は日本時間)

	5月8日	5月9日	5月10日	5月13日
加重平均金利	▲0.061	▲0.048	▲0.033	▲0.028
東京レポレート(ON)	▲0.084	▲0.063	▲0.067	▲0.068
無コール残	83,182	85,509	78,459	79,101
ON	50,303	51,100	47,055	46,647
その他	32,879	34,409	31,404	32,454
有コール残	23,850	24,951	22,164	23,434

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。

日本		予想	海外		予想
8:50	マネーストック(4月)	-	18:00	(欧)1-3月期域内総生産(GDP)改定値[前年比]	1.2%
	-		22:15	(米)4月鉱工業生産指数[前月比]	0.1%
	-			(米)リッチモンド連銀 総裁講演	

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	▲0.023	▲0.067
T/N	-	-	▲0.020	▲0.070
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.030	▲0.035	▲0.092
2W	-	-	▲0.040	▲0.103
3W	▲0.010	0.000	▲0.005	▲0.111
1M	-	-	▲0.025	▲0.123
2M	-	-	-	-
3M	-	-	▲0.040	▲0.132
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.157

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、▲0.025%の出合から始まった。その後は主に▲0.035%~▲0.015%の水準で取引された。ビッドサイドの調達ニーズは強く、同加重平均金利は前営業日対比+0.005%の▲0.023%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.035 ~ ▲0.020		▲0.030 ~ ▲0.020	▲0.035 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

積み最終日も引き続き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14日	5月15日	5月14日	5月15日	5月16日	5月17日
券	+3,300	+3,000		+3,000		+2,000
財政	▲3,400	+4,900		+4,900		+1,000
過不足	▲100	+7,900		+7,900		+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
国庫短期証券買入				+7,500		
国債買入		+7,600				
CP等買入				▲500		
ETF買入						+100
国債補完供給	+1,800	▲1,100	+1,100			
当座預金増減	+8,200	+16,100	+16,100			+3,000
当座預金残高	3,952,100	3,968,200	3,968,200			3,971,200
準備預金残高	3,483,300					
積み終了先	3,483,300					
超過準備	3,483,100					
非準備預金残高	468,800					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	96.7%					
乖離率	3.3%					

5月14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
国庫短期証券買入(5/15~)	7,500	19,726	7,501	0.006	0.015	36.1
米ドル資金供給(5/16~5/23)	0	0	2,870	2,870		
国債補完供給(5/14~5/15)	47,942	1,076	1,076	▲0.500	▲0.500	
	12,267	0	0			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
5月13日時点 5,081,600	今積期の所要準備額 3,084,800
	5月15日以降の残り所要積数 0
	平均 0

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16日	5年	
5月22日	20年	
5月28日	40年	
5月30日	2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(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会