

# DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年5月15日(水)

短期市場の推移

[億円] [%]

	5月9日	5月10日	5月13日	5月14日
加重平均金利	▲0.048	▲0.033	▲0.028	▲0.023
東京レポレート(ON)	▲0.063	▲0.067	▲0.068	▲0.067
無コール残	85,509	78,459	79,101	79,567
ON	51,100	47,055	46,647	46,433
その他	34,409	31,404	32,454	33,134
有コール残	24,951	22,164	23,434	22,035

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16日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想	
8:50	4月国内企業物価指数 [前年比]	+1.1%	21:30	(米)新規失業保険 申請件数[前週分]	-
8:50	企業物価指数(4月)	-	21:30	(米)4月住宅着工件数	122.0万戸
17:00	業態別の日銀当座 預金残高(4月)	-	21:30	(米)5月フィラデルフィア連 銀製造業景況指数	11.0

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	▲0.025	▲0.084
T/N	-	-	-	▲0.111
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.035	▲0.036	▲0.111
2W	▲0.045	▲0.020	▲0.029	▲0.115
3W	-	-	-	▲0.119
1M	▲0.038	▲0.030	▲0.034	▲0.123
2M	-	-	-	-
3M	-	-	▲0.040	▲0.133
6M	-	-	-	▲0.152
1Y	-	-	-	▲0.158

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

積み最終日となる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%~▲0.02%の水準で取引された。同加重平均金利は前営業日対比▲0.002%の▲0.025%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.035 ~ ▲0.025	▲0.050 ~ ▲0.020	▲0.050 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

新積み期に入るため、ビッドサイドは慎重な調達姿勢となると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月15日	5月16日	5月16日	5月17日	5月17日	5月18日
券	+3,100	+2,200	+2,200	+0	+0	+0
財政	+5,400	+1,800	+1,800	▲19,000	▲19,000	▲19,000
過不足	+8,500	+4,000	+4,000	▲19,000	▲19,000	▲19,000
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				+5,200		
CP等買入	▲500		▲100			
ETF買入		+100				
被災地金融機関支援					▲300	+300
国債補完供給	+1,100	▲1,100	+1,100			
当座預金増減		+15,600	+10,200	▲19,000		
当座預金残高		3,967,700	3,977,900	3,958,900		
準備預金残高		3,501,200	主な需給要因			
積み終了先		3,501,200				
超過準備		3,501,200				
非準備預金残高		466,500				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		100.0%				
乖離率		0.0%				

5月15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(5/16~)						
5~10年	4,800	13,119	4,811	0.000	0.001	50.9
物価連動	250	1,097	253	0.050	0.014	7.5
国債補完供給(5/15~5/16)						
	25,134	1,093	1,093	▲0.500	▲0.500	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
5月14日時点 5,086,600	来積み期の所要準備額 3,202,100
	5月16日以降の残り所要積数 3,202,100
	平均 103,300

国庫短期証券入札予定

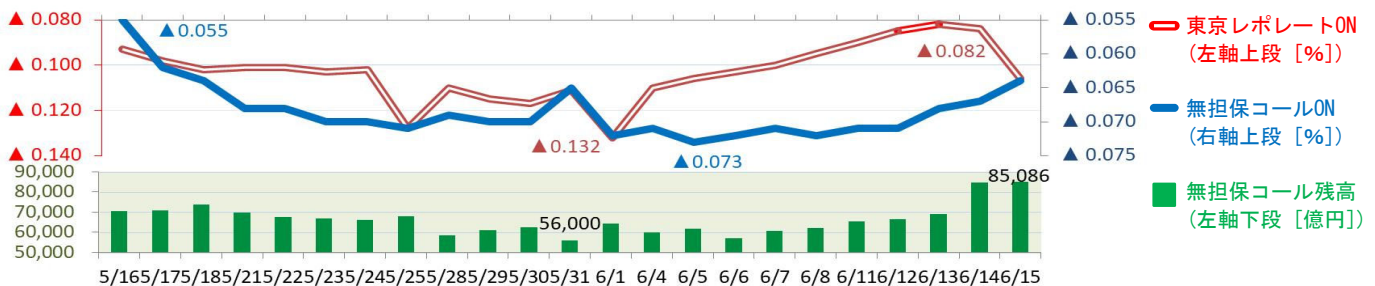
5月16日	1年	第832回
5月17日	3ヶ月	第833回
5月24日	3ヶ月	
5月31日	3ヶ月	
国債入札予定		
5月16日	5年	
5月22日	20年	
5月28日	40年	
5月30日	2年	

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15日	2
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	5月15日	1
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5月積み期 [5月16日~6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