

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年5月16日(木)

短期市場の推移 [億円][%] 5月17日の予定(時刻は日本時間)

	5月10日	5月13日	5月14日	5月15日
加重平均金利	▲0.033	▲0.028	▲0.023	▲0.025
東京レポレート(ON)	▲0.067	▲0.068	▲0.067	▲0.084
無コール残	78,459	79,101	79,567	78,917
ON	47,055	46,647	46,433	48,658
その他	31,404	32,454	33,134	30,259
有コール残	22,164	23,434	22,035	23,017

	日本	予想	海外	予想
	-		23:00 (米)4月景気先行指数	0.2%
	-		23:00 (米)5月ミシガン大消費者信頼感指数速報	97.9
	-		(欧)4月CPI	

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	▲0.086	0.001	▲0.066	▲0.096
T/N	-	-	-	▲0.111
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	▲0.035	▲0.041	▲0.112
2W	▲0.048	▲0.015	▲0.042	▲0.114
3W	-	-	▲0.015	▲0.118
1M	-	-	▲0.045	▲0.122
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.131
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.157

本日の市況

本日の無担保コールON物は、▲0.075%の出合から始まった。その後は主に▲0.085%~▲0.035%の水準で取引された。新積み期に入り、ビッドサイドが慎重な動きとなったことから、同加重平均金利は前営業日対比▲0.041%の▲0.066%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.085 ~ ▲0.070	▲0.085 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

週末3日積みとなるものの、本日と同様に軟調な地合が予想される。

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

資金需給 [億円]

	日銀速報 5月16日	日銀予想 5月17日	当社需給予想 5月20日
券	+2,400	+2,100	+1,000
財政	+200	▲19,300	+1,000
過不足	+2,600	▲17,200	+2,000
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	+5,200		
共通担保(全店)			▲1,500
CP等買入	▲100	▲100	
ETF買入		+700	
被災地金融機関支援		▲300	+300
国債補完供給	+1,100	▲900	+900
当座預金増減	+7,900	▲15,700	+500
当座預金残高	3,975,600	3,959,900	3,960,400
準備預金残高	3,473,600	主な需給要因	
積み終了先	2,126,800	国債償還(変動15年)	
超過準備	894,200	国庫短期証券発行・償還(3M・1Y)	
非準備先残高	502,000	国債発行(5年)	
準備預金進捗率	80.6%		
平均	3.2%		
乖離率	77.3%		

5月16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
CP等買入(5/21~)	2,500	7,187	2,470	▲0.001	0.004	74.0
国債補完供給(5/16~5/17)	40,000	908	908	▲0.500	▲0.500	

マナタリーベース [億円]
5月15日時点 5,099,100

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,202,100
5月17日以降の残り所要積数 622,700
平均 20,800

国庫短期証券入札予定

5月17日	3ヶ月	第833回
5月24日	3ヶ月	
5月31日	3ヶ月	
6月6日	6ヶ月	
5月22日	20年	
5月28日	40年	
5月30日	2年	
6月4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	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。