

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年5月23日(木)

短期市場の推移

[億円] [%]

	5月17日	5月20日	5月21日	5月22日
加重平均金利	▲0.068	▲0.068	▲0.065	▲0.058
東京レポレート(ON)	▲0.093	▲0.089	▲0.086	▲0.084
無コール残	77,130	73,956	78,918	80,943
ON	48,130	44,806	48,318	50,543
その他	29,000	29,150	30,600	30,400
有コール残	28,536	22,110	22,567	21,832

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24日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	4月消費者物価コア指数 [前年比]	+0.9%	17:30	(英)4月小売売上高指数 [前月比]	-0.1%
	-			-	
	-			-	

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

本日の市況

	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	▲0.049	▲0.090
T/N	-	-	-	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	0.230	▲0.025	▲0.089
2W	▲0.045	▲0.035	▲0.040	▲0.092
3W	-	-	-	▲0.095
1M	-	-	▲0.015	▲0.104
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.124
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

本日の無担保コールON物は、▲0.055%の出合から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.035%の水準で取引された。引き続きビッドサイドの資金調達ニーズは強く、同加重平均金利は前営業日対比+0.009%の▲0.049%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.055	▲0.045 ~ ▲0.035	▲0.075 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

引き続き資金調達ニーズは高いと思われるため、出合レンジは上昇すると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	5月23日	5月24日	5月24日	5月27日	5月27日
券	▲100	+300	+300	+1,000	+1,000
財政	▲7,000	+8,400	+8,400	▲4,000	▲4,000
過不足	▲7,100	+8,700	+8,700	▲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
共通担保(全店)					
CP等買入	▲100	▲200	▲200		
社債等買入		▲200	▲200	▲3,000	
ETF買入			+700		
国債補完供給	+200				+1,000
当座預金増減	▲7,000	+9,000	+9,000	▲5,000	▲5,000
当座預金残高	3,972,400	3,981,400	3,981,400	3,976,400	3,976,400
準備預金残高	3,483,300	主な需給要因			
積み終了先	3,482,400				
超過準備	3,481,800				
非準備預金残高	489,100	国庫短期証券 発行・償還 (3M)			
準備預金進捗率	99.8%				
平均	25.8%				
乖離率	74.0%				

5月23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
国債補完供給(5/23~5/24)	25,690	1	1	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]
5月22日時点 5,101,100

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,202,100
5月24日以降の残り所要
積数 7,700
平均 300

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

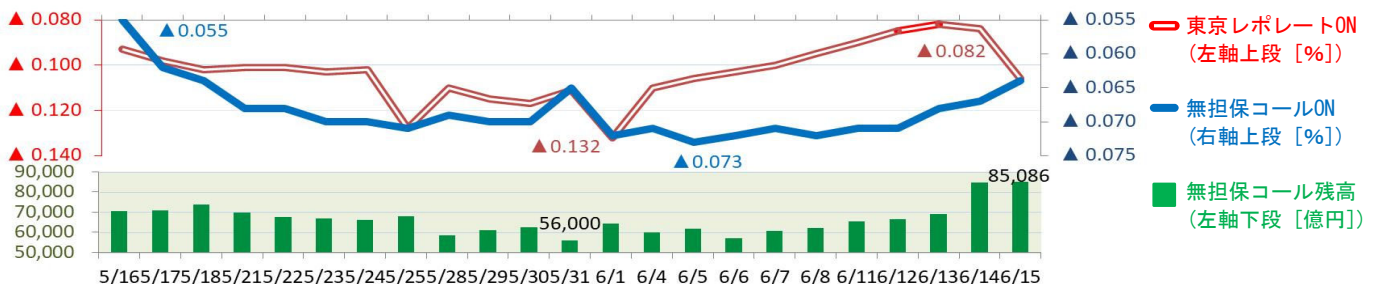
5月24日	3ヶ月	第834回
5月31日	3ヶ月	
6月6日	6ヶ月	
6月7日	3ヶ月	
5月28日	40年	
5月30日	2年	
6月4日	10年	
6月13日	30年	

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21日	1
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	9/15 21/31	5月21日	1
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17日	2
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	5月21日	0
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