

短期市場の推移

[億円] [%]

	5月1日	5月7日	5月8日	5月11日
加重平均金利	▲0.044	▲0.035	▲0.027	▲0.019
東京レポレート(ON)	▲0.061	▲0.065	▲0.087	▲0.087
無コール残	112,381	113,551	107,859	95,169
ON	69,692	68,177	63,705	52,535
その他	42,689	45,374	44,154	42,634
有コール残	18,713	17,870	17,764	18,311

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13日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 国際収支状況(3月速報)	-	18:00 (欧)3月鉱工業生産指数 [前月比]	-12.0%
-	-	21:30 (米)4月生産者物価コア 指数[前年比]	0.8%
-	-	-	-

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	▲0.060	0.001	▲0.022	▲0.102
T/N	-	-	-	▲0.133
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.020	▲0.115
2W	-	-	0.001	▲0.115
3W	-	-	-	▲0.118
1M	-	-	-	▲0.120
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.005	▲0.129
6M	-	-	-	▲0.171
1Y	-	-	-	▲0.187

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▲0.015%の出合から始まり、その後は主に▲0.025%~▲0.010%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比▲0.003%の▲0.022%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.020	▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.030 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

積み終盤にさしかかって調達を控える先もあり、金利は本日対比低下すると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	5月12日	5月13日	5月14日
券	+1,700	+800	+1,000
財政	+13,400	▲25,900	+1,000
過不足	+15,100	▲25,100	+2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+15,000
国債買入	+7,300	▲200	
CP等買入	▲500		
ETF買入	+800		
国債補完供給	+800	▲200	+200
米ドル資金供給用担保国債供給		▲1,000	
当座預金増減	+23,300	▲11,100	+2,000
当座預金残高	4,045,600	4,034,500	4,036,500
準備預金残高	3,499,000		
積み終了先	3,498,700		
超過準備	3,498,700		
非準備先残高	546,600		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	90.0%		
乖離率	9.9%		

5月12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	按分
国庫短期証券買入(5/13~)	15,000	33,491	15,001	0.000	0.007	58.8
米ドル資金供給(5/14~5/21)		9,489		0.310	0.310	
米ドル資金供給(5/14~8/6)		2,890		0.300	0.300	
国債補完供給(5/12~5/13)		202	202	▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給用担保国債供給(5/13~8/7)		5,000	977	▲0.100	▲0.100	

マネタリーベース [億円]
5月11日時点 5,186,700

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,220,500
5月13日以降の残り所要
積数 600
平均 200

国庫短期証券入札予定

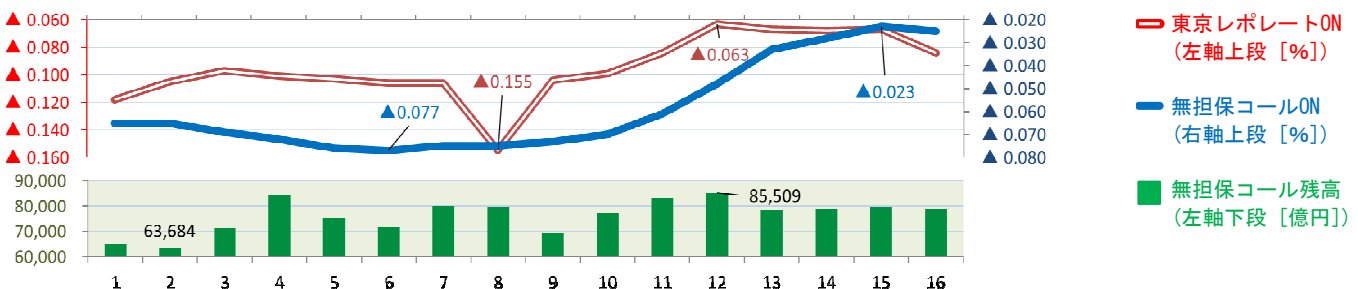
5月15日	3ヶ月	第907回
5月19日	1年	第908回
5月22日	3ヶ月	
5月27日	6ヶ月	
国債入札予定		
5月14日	30年	
5月18日	5年	
5月20日	20年	
5月26日	40年	

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	500~1,000	800	月3回程度	5月7日	2
1年超3年以下	2,000~5,000	3,400	7 11 13 19 21 25	5月11日	4
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	11 13 21 25 29	5月11日	4
5年超10年以下	2,000~5,500	3,700	7 15 19 25 29	5月7日	4
10年超25年以下	500~2,000	1,200	13 29	4月24日	2
25年超	0~500	300	11 19	5月11日	1
物価連動債	300	300	月2回程度	4月24日	2
変動利付債<偶数月>	1,000	1,000	-	4月6日	-

1年前の市場推移 ○2019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。