

短期市場の推移

	5月13日	5月14日	5月15日	5月18日
加重平均金利	▲0.026	▲0.020	▲0.040	▲0.058
東京レポレート(ON)	▲0.099	▲0.100	▲0.096	▲0.124
無コール残	107,149	108,029	109,241	113,323
ON	63,235	65,185	70,307	69,164
その他	43,914	42,844	38,934	44,159
有コール残	21,371	19,313	18,496	16,306

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20日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想	
8:50	3月コア機械受注[前月比]	▲8.5%	17:00 (欧)3月経常収支	-
			(米)週間MBA住宅ローン申請指数	
			(米)FOMC議事要旨(4月28日-29日開催分)	

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	▲0.087	0.001	▲0.061	▲0.125
T/N	▲0.087	▲0.001	▲0.042	▲0.139
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.010	▲0.037	▲0.128
2W	-	-	▲0.035	▲0.129
3W	-	-	-	▲0.127
1M	-	-	▲0.050	▲0.127
2M	-	-	0.020	-
3M	-	-	0.035	▲0.131
6M	-	-	-	▲0.166
1Y	-	-	-	▲0.180

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▲0.065%の出合から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.030%の水準で出合が見られた。引き続きビッドサイドは慎重な調達姿勢となり、同加重平均金利(速報)は、前営業日対比▲0.003%の▲0.061%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.060	▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.070 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

引き続き軟調な地合が継続すると予想。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	5月19日	5月20日	5月21日
券	+800	+300	+0
財政	▲35,000	+33,000	▲16,000
過不足	▲34,200	+33,300	▲16,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+7,900
CP等買入	▲300	▲400	
ETF買入	+100	+900	
国債補完供給	+1,000	+300	▲100
米ドル資金供給用担保国債供給			
当座預金増減	▲33,700	+41,900	▲16,000
当座預金残高	4,139,100	4,181,000	4,165,000
準備預金残高	3,573,700	主な需給要因	
積み終了先	3,561,900	国庫短期証券発行・償還(1Y)	
超過準備	3,554,100	国債償還(変動15年)	
非準備先残高	565,400		
準備預金進捗率	99.0%		
平均	12.9%		
乖離率	86.1%		

5月19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(5/20~)						
1~3年	3,400	8,983	3,401	0.014	0.016	90.0
5~10年	3,700	6,490	3,714	0.016	0.017	64.2
25年~	300	896	304	0.011	0.012	97.7
物価連動	300	1,110	302	▲0.250	▲0.290	100.0
米ドル資金供給(5/21~5/28)						
		9,292	9,292	0.310	0.310	
米ドル資金供給(5/21~8/13)						
		2,373	2,373	0.310	0.310	
国債補完供給(5/19~5/20)						
	222	222	▲0.350	▲0.350		
	1	1	▲0.350	▲0.350		
米ドル資金供給用担保国債供給(5/20~5/29)						
	5,000	2	▲0.100	▲0.100		
米ドル資金供給用担保国債供給(5/20~8/14)						
	5,000	68	▲0.100	▲0.100		

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
5月18日時点 5,332,200	今積期の所要準備額 3,360,900
	5月20日以降の残り所要積数 32,500
	平均 1,200

国庫短期証券入札予定

5月22日	3ヶ月	第909回
5月27日	6ヶ月	
5月29日	3ヶ月	
6月5日	3ヶ月	
国債入札予定		
5月20日	20年	
5月26日	40年	
5月28日	2年	
6月2日	10年	

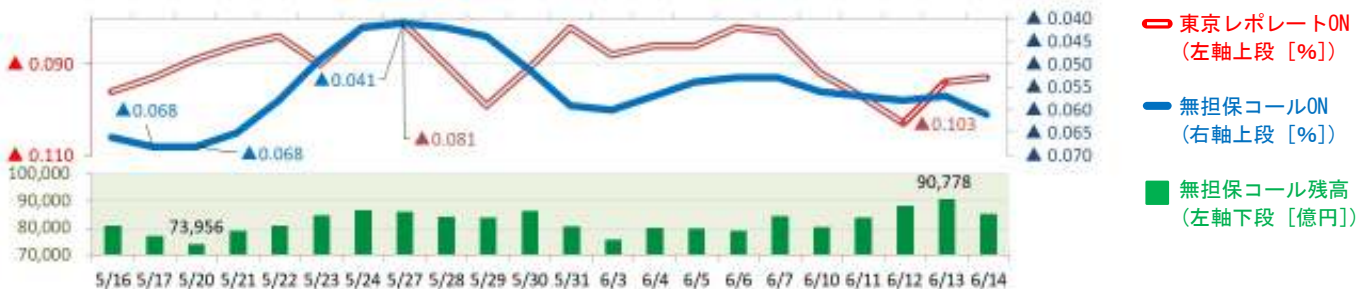
今月の国債買入オペ予定

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	500~1,000	800	月3回程度	5月15日	1
1年超3年以下	2,000~5,000	3,400	7 11 13 19 21 25	5月19日	2
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	11 13 21 25 29	5月13日	3
5年超10年以下	2,000~5,500	3,700	7 15 19 25 29	5月19日	2
10年超25年以下	500~2,000	1,200	13 29	5月13日	1
25年超	0~500	300	11 19	5月19日	0
物価連動債	300	300	月2回程度	5月19日	1
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5月積み期 [5月16日~6月14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。