

平成30年5月14日(月)

短期市場の推移 [億円][%]

	5月8日	5月9日	5月10日	5月11日
ON加重	▲0.063	▲0.052	▲0.042	▲0.034
東京レポレート(ON)	▲0.064	▲0.060	▲0.058	▲0.055
無担保残	77,178	81,372	78,215	86,224
ON	47,626	51,520	48,585	56,794
その他	29,552	29,852	29,630	29,430
有担保残	24,740	25,480	24,469	26,536

ON加重、無担保・有担保残は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

5月15日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	15:00 (独)1-3月期国内総生産(GDP)速報値[前年比]	2.4%
-	-	18:00 (欧)1-3月期域内総生産(GDP)改定値[前年比]	2.5%
-	-	21:30 (米)4月小売売上高	0.3%

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

短期市場金利 [%]

	無担保コール(速報)			レポ市場 東京レポレート
	最低	最高	平均	
O/N	▲0.070	0.001	▲0.034	▲0.052
T/N	-	-	0.000	▲0.061
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.035	▲0.080
2W	▲0.045	▲0.035	▲0.038	▲0.088
3W	-	-	▲0.035	▲0.096
1M	▲0.043	▲0.040	▲0.041	▲0.110
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.130
6M	-	-	-	▲0.148
1Y	-	-	-	▲0.160

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▲0.035%からの出合から始まった。昨日同様の堅調な地合となり、主に▲0.035~▲0.03%の水準で出合が見られた。ON加重平均金利は▲0.034%となった。

O/N業態別出合レンジ [%]

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.030	▲0.035 ~ ▲0.035	▲0.050 ~ ▲0.025

明日のマーケット

積最終日となる明日は、引き続き堅調な地合が継続する見込み。中心の出合は▲0.04~▲0.03%を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月14日	5月15日	5月14日	5月15日	5月16日	5月17日
券		+1,500		+1,300		+1,000
財政		▲11,600		▲13,200		▲7,000
過不足		▲10,100		▲11,900		▲6,000
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				+12,500		
国債買入		+3,100		+10,400		
共通担保(全店)	▲2,400	+2,000				
CP等買入	▲300		▲700			
国債補完供給	+1,000					
当座預金増減		▲6,700		+10,300		▲6,000
当座預金残高		3,830,200		3,840,500		3,834,500
準備預金残高		3,381,300				主な需給要因
積み終了先		3,381,100				
超過準備		3,381,100				
非準備先残高		448,900				国債発行・償還(2年)
準備預金進捗率		99.9%				国債発行(30年)
平均		96.7%				
乖離率		3.2%				

5月14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(5/15~)	12,500	33,982	12,504	0.000	0.002	0.5
国債買入(5/15~)						
1~3年	2,500	11,408	2,500	0.004	0.005	
3~5年	3,300	12,430	3,306	0.002	0.003	2.9
5~10年	4,500	18,028	4,507	0.002	0.002	39.4
国債補完供給(5/14~5/15)						
	76,837	36	36	▲0.500	▲0.500	
	4,586	3	3	▲0.500	▲0.500	

マナリーベース [億円]
5月11日時点 4,923,700

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,026,100
5月15日以降の残り所要積数	100
平均	100

国庫短期証券入札予定

5月17日	1年	第758回
5月18日	3ヶ月	第759回
5月25日	3ヶ月	
6月1日	3ヶ月	
国債入札予定		
5月15日	30年	
5月17日	5年	
5月22日	20年	
5月29日	40年	

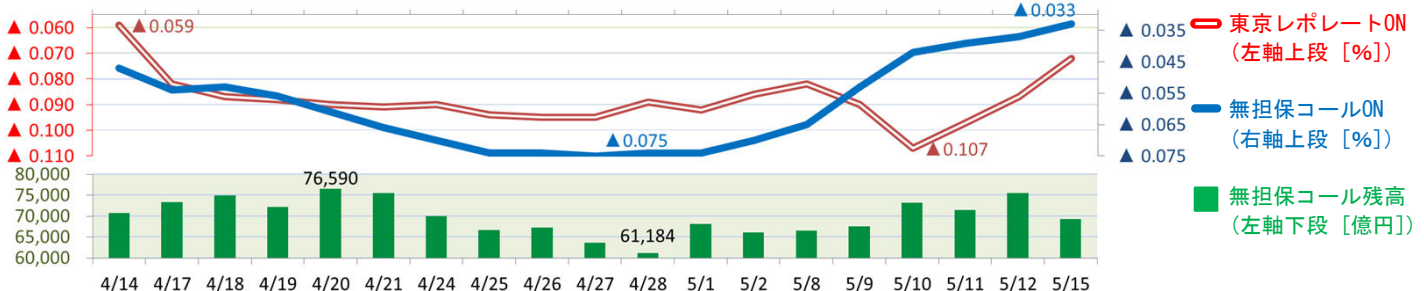
今月の国債買入オペ予定

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	100~1,000 程度	500	月2回程度	5月1日	1
1年超3年以下	2,000~3,000 程度	2,500			
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,300			
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,500			
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,900			
25年超	500~1,500 程度	700			
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	5月11日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	4月18日	-

1年前の市場推移

○2017年4月積み期 [4月14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。