

短期市場の推移 [億円] [%]

	5月9日	5月10日	5月11日	5月14日
ON加重	▲0.052	▲0.042	▲0.034	▲0.034
東京レポレート(ON)	▲0.060	▲0.058	▲0.055	▲0.052
無担保残	81,372	78,215	86,224	82,506
ON	51,520	48,585	56,794	53,626
その他	29,852	29,630	29,430	28,880
有担保残	25,480	24,469	26,536	26,143

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16日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	1-3月期国内総生産(GDP)速報値[前期比年率]	0.0%	21:30	(米)4月住宅着工件数	130.5万戸
17:00	業態別の日銀当座預金残高(4月)	-	22:15	(米)4月鉱工業生産指数[前月比]	0.5%
				アトランタ連銀総裁講演	-

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 東京レポレート
	最低	最高	平均	
O/N	▲0.070	0.001	▲0.036	▲0.066
T/N	▲0.035	0.001	▲0.010	▲0.084
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	0.230	▲0.030	▲0.094
2W	-	-	▲0.045	▲0.099
3W	-	-	0.035	▲0.106
1M	-	-	-	▲0.117
2M	-	-	-	-
3M	-	-	▲0.020	▲0.133
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

積最終日となる本日の無担保コールON物は、▲0.03%からの出合から始まった。引き続き調達意欲は強く、主に▲0.04~▲0.03%の水準で出合が見られた。ON加重平均金利は昨日から0.2bp低下し、▲0.036%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	▲0.060 ~ ▲0.030

明日のマーケット

積初日となる明日は、調達サイドの慎重なスタートが予想される。▲0.07~▲0.04%が出合の中心か。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月15日	5月16日	5月16日	5月17日	5月17日	5月17日
券		+1,300		+1,200		+0
財政		▲12,900		▲6,700		+4,000
過不足		▲11,600		▲5,500		+4,000
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		+10,400				
CP等買入	▲700		▲200			
ETF買入						
国債補完供給		▲2,100	+2,100		+100	
当座預金増減		+8,500	▲3,500		+4,000	
当座預金残高		3,838,700	3,835,200		3,839,200	
準備預金残高		3,381,700				
積み終了先		3,381,700				
超過準備		3,381,600				
非準備先残高		457,000				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		100.0%				
乖離率		0.0%				

5月15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
米ドル資金供給(5/17~5/24)		1	1	2,210	2,210	
CP等買入(5/18~)	2,000	5,696	1,981	▲0.007	0.000	53.5
国債補完供給(5/15~5/16)	91,448	1,926	1,926	▲0.500	▲0.500	
	10,000	130	130	▲0.500	▲0.500	

マナリーベース [億円]
5月14日時点 4,915,600

所要 [億円]
来積期の所要準備額 3,128,500
5月16日以降の残り所要積数 3,128,500
平均 100,900

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17日	5年	
5月22日	20年	
5月29日	40年	
5月31日	2年	

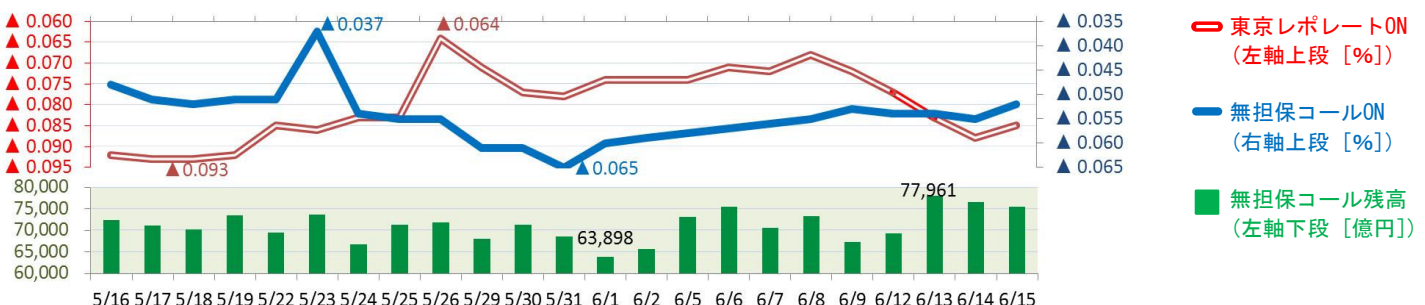
今月の国債買入オペ予定

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	7 9 14 18 23 25	5月14日	3
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,500	7 9 14 18 25 30	5月14日	3
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,900			
25年超	500~1,500 程度	700	7 11 16 23 30	5月11日	3
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。