

短期市場の推移 [億円][%]

	5月11日	5月14日	5月15日	5月16日
加重平均金利	▲0.034	▲0.034	▲0.036	▲0.055
東京レポレート(ON)	▲0.055	▲0.052	▲0.066	▲0.093
無コール残	86,224	82,506	84,642	70,357
ON	56,794	53,626	55,762	43,757
その他	29,430	28,880	28,880	26,600
有コール残	26,536	26,143	24,347	21,463

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18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]	+0.7%	17:00	(欧)3月経常収支	-
	-		18:00	(欧)3月貿易収支	-
	-			ブレインードFRB理事講演	

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	▲0.086	0.001	▲0.062	▲0.098
T/N	-	-	0.000	▲0.135
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.055	▲0.030	▲0.041	▲0.141
2W	▲0.050	▲0.035	▲0.045	▲0.142
3W	-	-	-	▲0.144
1M	-	-	0.001	▲0.148
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.148
6M	-	-	-	▲0.149
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、▲0.065%の出合から始まった。その後は主に▲0.086~▲0.05%と広いレンジ推移した。昨日より軟調な展開となり、ON加重平均金利は昨日から0.7bp低下の▲0.062%。

O/N業態別出合レンジ [%]

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.085	▲0.086 ~ ▲0.065	▲0.086 ~ ▲0.045

明日のマーケット

明日は3日積みとなるが、引き続きビッドサイドの調達ニーズは限定的か。出合の中心は▲0.086~▲0.05%を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月17日	5月18日	5月18日	5月19日	5月21日	5月22日
券		▲100		+200		+1,000
財政		+300		▲12,700		▲5,000
過不足		+200		▲12,500		▲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
国債買入		+3,300				
共通担保(全店)						
CP等買入	▲100		▲200	+2,000	▲1,900	
社債等買入			▲100			
ETF買入				+700		
被災地金融機関支援				+300		
国債補充供給	+2,000	▲1,900	+1,900			
当座預金増減		+3,500		▲7,900		▲5,900
当座預金残高		3,836,000		3,828,100		3,822,200
準備預金残高		3,369,500				
積み終了先		3,247,900				
超過準備		2,897,000				
非準備先残高		466,500				
準備預金進捗率		95.4%				
平均		6.5%				
乖離率		89.0%				

5月17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
国債補充供給(5/17~5/18)	63,040	1,838	1,838	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]
 5月16日時点 4,915,400

所要 [億円]
 今積期の所要準備額 3,128,500
 5月18日以降の残り所要積数 142,700
 平均 4,900

国庫短期証券入札予定

5月18日	3ヶ月	第759回
5月25日	3ヶ月	
6月1日	3ヶ月	
6月7日	6ヶ月	
5月22日	20年	
5月29日	40年	
5月31日	2年	
6月5日	10年	

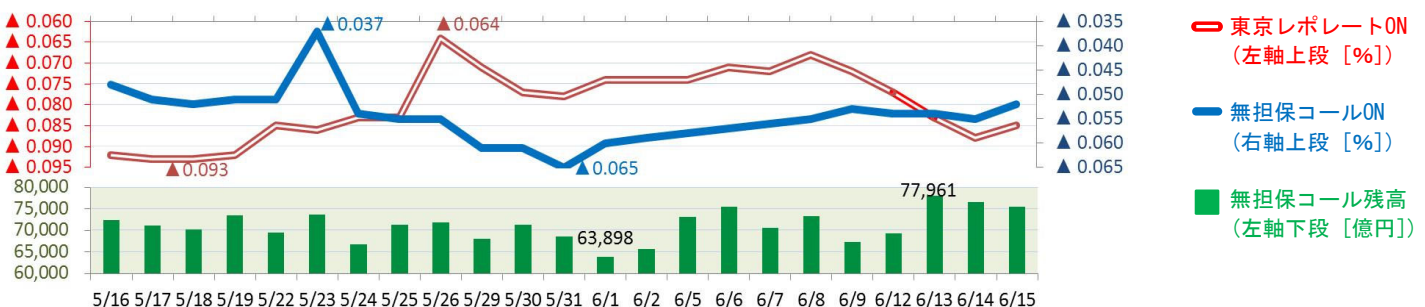
今月の国債買入オペ予定

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	100~1,000 程度	500	月2回程度	5月16日	0	
1年超3年以下	2,000~3,000 程度	2,500	7 9 14	18 23 25	5月14日	3
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,300	7 9 14	18 25 30	5月14日	3
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,500	7 11 16	23 30	5月16日	2
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。