

短期市場の推移 [億円][%]

	5月14日	5月15日	5月16日	5月17日
加重平均金利	▲0.034	▲0.036	▲0.055	▲0.062
東京レポレート(ON)	▲0.052	▲0.066	▲0.093	▲0.098
無コール残	82,506	84,642	70,357	70,745
ON	53,626	55,762	43,757	43,895
その他	28,880	28,880	26,600	26,850
有コール残	26,143	24,347	21,463	23,046

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21日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	4月貿易収支	-	21:30	(米)4月シカゴ連銀全米活動指数	-
	-			アトランタ連銀総裁講演	
	-			フィラデルフィア連銀総裁講演	

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	▲0.086	0.001	▲0.064	▲0.102
T/N	-	-	0.000	▲0.129
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.001	▲0.026	▲0.140
2W	-	-	-	▲0.142
3W	-	-	0.035	▲0.144
1M	-	-	▲0.010	▲0.149
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、▲0.05%の出合から始まった。その後は主に▲0.086~▲0.05%で出合が見られた。本日もレート低下傾向が継続し、ON加重平均金利は昨日から0.2bp低下の▲0.064%となった。

O/N業態別出合レンジ [%]

都銀・信託		証券		地銀	
▲0.086	▲0.086	▲0.070	▲0.070	▲0.086	▲0.050

明日のマーケット

週明け21日も▲0.086%~▲0.05%中心の軟調な地合が継続か。

資金需給 [億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月18日	5月21日	5月21日	5月22日	5月22日	5月22日
券		+200		+700		+0
財政		▲12,700		▲4,000		▲3,000
過不足		▲12,500		▲3,300		▲3,000
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				+10,400		
共通担保(全店)			▲1,900	+2,000		
CP等買入	▲200	+2,000	▲400			
社債等買入	▲100					
ETF買入		+700				
被災地金融機関支援		+300				
国債補完供給	+1,900	▲500	+500			
当座預金増減		▲8,400		+7,300		▲3,000
当座預金残高		3,827,600		3,834,900		3,831,900
準備預金残高		3,353,500				
積み終了先		3,337,200				
超過準備		3,314,700				
非準備先残高		474,100				
準備預金進捗率		99.2%				
平均		16.1%				
乖離率		83.0%				

5月18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
国債買入(5/21~)						
1~3年	2,500	9,431	2,508	0.006	0.007	54.9
3~5年	3,300	9,745	3,307	0.006	0.007	12.4
5~10年	4,500	13,674	4,507	0.005	0.006	66.1
国債補完供給(5/18~5/21)						
共通担保(全店)(5/21~6/4)	8,000	1,983	1,983			

マナリーベース [億円]
5月17日時点 4,918,900

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,128,500
5月21日以降の残り所要積数 26,500
平均 1,000

国庫短期証券入札予定

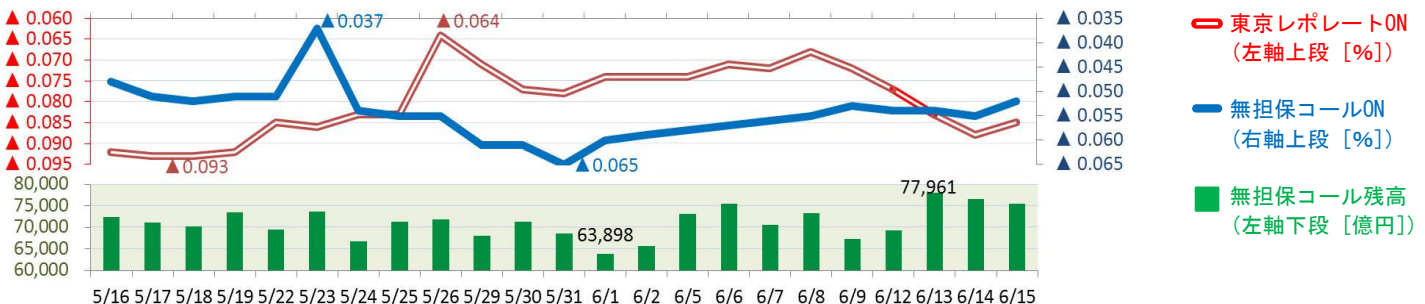
5月25日	3ヶ月	第760回
6月1日	3ヶ月	
6月7日	6ヶ月	
6月8日	3ヶ月	
5月22日	20年	
5月29日	40年	
5月31日	2年	
6月5日	10年	

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			
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。