

短期市場の推移

	5月15日	5月16日	5月17日	5月18日
加重平均金利	▲0.036	▲0.055	▲0.062	▲0.064
東京レポレート(ON)	▲0.066	▲0.093	▲0.098	▲0.102
無コール残	84,642	70,357	70,745	73,801
ON	55,762	43,757	43,895	47,151
その他	28,880	26,600	26,850	26,650
有コール残	24,347	21,463	23,046	22,708

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22日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:00	日銀営業毎旬報告 (5月20日現在)	-	米韓首脳会談 (ワシントン)	-
14:00	基調的なインフレ率を捕捉するための指標 (4月)	-	-	-

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	▲0.086	0.001	▲0.068	▲0.101
T/N	-	-	0.000	▲0.117
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.055	▲0.020	▲0.044	▲0.131
2W	▲0.038	▲0.032	▲0.034	▲0.134
3W	-	-	-	▲0.138
1M	-	-	-	▲0.142
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.146
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、▲0.06%の出合から始まった。その後は主に▲0.086~▲0.06%で出合が見られた。本日も調達意欲の弱い地合となり、ON加重平均金利は昨日から0.4bp低下の▲0.068%となった。

O/N業態別出合レンジ

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.075	▲0.086 ~ ▲0.075	▲0.086 ~ ▲0.050

明日のマーケット

22日も主に▲0.086%~▲0.05%で取引される軟調な地合が継続か。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月21日		5月22日		5月23日	
券	+600		+500		▲1,000	
財政	▲6,200		+2,900		▲12,000	
過不足	▲5,600		+3,400		▲13,000	
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				+10,000		
国債買入		+10,400				
共通担保(全店)	▲1,900	+2,000				
CP等買入	▲400		▲300			
社債等買入			▲100			
ETF買入				+300		
国債補完供給	+500	▲700	+700			
当座預金増減	+4,300		+14,000		▲13,000	
当座預金残高	3,831,900		3,845,900		3,832,900	
準備預金残高	3,354,500		主な需給要因			
積み終了先	3,351,600					
超過準備	3,346,900					
非準備先残高	477,400		国債発行 (20年)			
準備預金進捗率	99.4%					
平均	19.4%					
乖離率	80.0%					

5月21日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国庫短期証券買入 (5/22~)	10,000	27,280	10,004	▲0.003	▲0.001	82.0
国債補完供給 (5/21~5/22)	171,755	664	664	▲0.600	▲0.600	
	20,852	74	74	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]
5月18日時点 4,910,300

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,128,500
5月22日以降の残り所要
積数 19,000
平均 800

国庫短期証券入札予定

5月25日	3ヶ月	第70回
6月1日	3ヶ月	
6月7日	6ヶ月	
6月8日	3ヶ月	

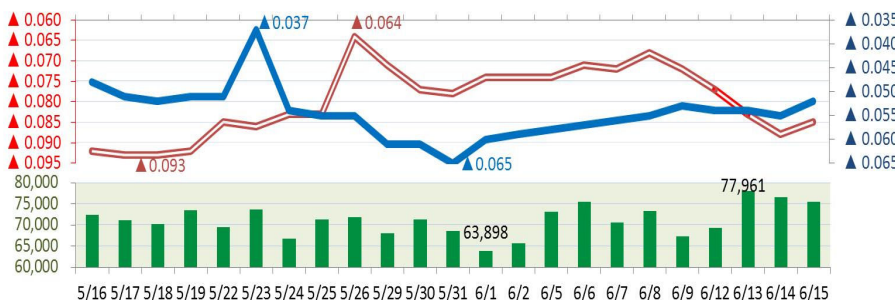
今月の国債買入オペ予定

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18日	2
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,300	7 9 14 18 23 25	5月18日	2
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,500	7 9 14 18 23 30	5月18日	2
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,900	7 11 16 23 30	5月16日	2
25年超	500~1,500 程度	700	7 11 16 23 30	5月16日	2
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。



▲ 東京レポレートON (左軸上段 [%])
▲ 無担保コールON (右軸上段 [%])
■ 無担保コール残高 (左軸下段 [億円])

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。 上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会