

短期市場の推移

	5月16日	5月17日	5月18日	5月21日
加重平均金利	▲0.055	▲0.062	▲0.064	▲0.068
東京レポレート(ON)	▲0.093	▲0.098	▲0.102	▲0.101
無コール残	70,357	70,745	73,801	69,554
ON	43,757	43,895	47,151	42,744
その他	26,600	26,850	26,650	26,810
有コール残	21,463	23,046	22,708	22,372

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23日の予定(時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
8:50	預金種類別店頭表示金利の平均年利率等	-	日米外相会談(ワシントン)	-
13:30	3月の全産業活動指数(経産省)	-	(欧)5月製造業PMI	54.5
	5月の月例経済報告(内閣府)	-	(米)5月製造業PMI	56.1

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	▲0.068	▲0.101
T/N	-	-	0.000	▲0.110
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.035	▲0.046	▲0.126
2W	▲0.050	▲0.010	▲0.042	▲0.132
3W	-	-	-	▲0.134
1M	-	-	▲0.010	▲0.138
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.143
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、▲0.08%の出合から始まった。その後は主に▲0.086%~▲0.055%で出合が見られた。本日も昨日同様軟調な地合となり、同加重平均金利は前日対比横ばいの▲0.068%となった。

O/N業態別出合レンジ

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.080	▲0.081 ~ ▲0.080	▲0.086 ~ ▲0.055

明日のマーケット

明日も軟調な地合が継続する見込み。
 主に▲0.086%~▲0.055%で取引されると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月22日	5月23日	5月23日	5月24日	5月24日	5月24日
券		+400		▲300		▲1,000
財政		▲400		▲13,200		▲1,000
過不足		+0		▲13,500		▲2,000
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				
CP等買入	▲300		▲200			
社債等買入	▲100					
ETF買入		+300				
国債補完供給	+700	▲400	+400			
当座預金増減		+10,200		▲13,300		▲2,000
当座預金残高		3,842,100		3,828,800		3,826,800
準備預金残高		3,366,400	主な需給要因			
積み終了先		3,363,900				
超過準備		3,363,300				
非準備先残高		475,700				
準備預金進捗率		99.5%				
平均		22.6%				
乖離率		76.9%				

5月22日のオペ結果

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(5/24~6/1)						
社債等買入(5/28~)	1,000	1,711	1,000	▲0.224	▲0.186	43.9
国債補完供給(5/22~5/23)						
	53,790	140	140	▲0.600	▲0.600	
	20,982	248	248	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]
 5月21日時点 4,914,000

所要 [億円]
 今積期の所要準備額 3,128,500
 5月23日以降の残り所要積数 15,900
 平均 700

国庫短期証券入札予定

入札日	残高	回数
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	

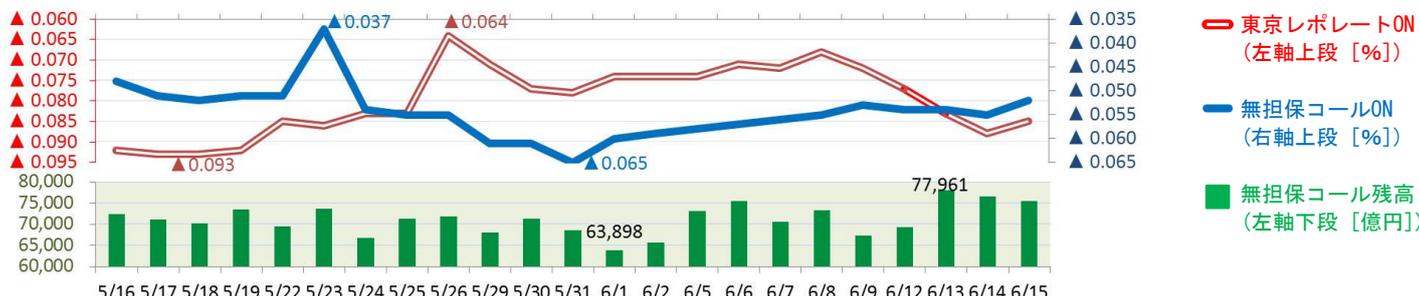
今月の国債買入オペ予定

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 30	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	月2回程度	5月11日	1
物価連動債	250 程度	250		4月18日	-
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000			

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。 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