

短期市場の推移

[億円][%]

	5月17日	5月18日	5月21日	5月22日
加重平均金利	▲0.062	▲0.064	▲0.068	▲0.068
東京レポレート(ON)	▲0.098	▲0.102	▲0.101	▲0.101
無コール残	70,745	73,801	69,554	67,392
ON	43,895	47,151	42,744	41,432
その他	26,850	26,650	26,810	25,960
有コール残	23,046	22,708	22,372	20,588

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24日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
10:30	【挨拶】櫻井日銀審議委員(群馬)	15:00	(独)1-3月期国内総生産(GDP)改定値(前年比)
14:00	3月の景気動向指数改定値(内閣府)		(欧)米NY連銀総裁の講演(ロンドン)
	-		(欧)ユーロ圏財務相会合(ブリュッセル)

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	▲0.070	▲0.103
T/N	-	-	0.000	▲0.116
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	▲0.040	▲0.050	▲0.128
2W	-	-	▲0.050	▲0.131
3W	-	-	-	▲0.134
1M	-	-	-	▲0.138
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.144
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、▲0.085%の合出から始まった。その後は主に▲0.086%~▲0.060%の水準で取引される軟調な地合となった。同加重平均金利は前日対比▲0.002%の▲0.070%まで低下した。

O/N業態別合出レンジ

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲ 0.086 ~ ▲ 0.085	▲ 0.085 ~ ▲ 0.085	▲ 0.086 ~ ▲ 0.060

明日のマーケット

明日も本日同様、軟調な地合が継続する見込み。
主に▲0.086%~▲0.060%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23日		5月24日		5月25日	
券	▲300		▲1,300		▲1,000	
財政	▲14,200		+800		▲6,000	
過不足	▲14,500		▲500		▲7,000	
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				+8,600		
CP等買入	▲200		▲400			
国債補完供給	+400	▲300	+300			
当座預金増減	▲14,600		+8,000		▲7,000	
当座預金残高	3,827,500		3,835,500		3,828,500	
準備預金残高	3,352,500		主な需給要因			
積み終了先	3,350,200					
超過準備	3,350,200					
非準備先残高	475,000					
準備預金進捗率	99.6%					
平均	25.8%					
乖離率	73.8%					

5月23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(5/24~)						
1~3年	2,500	10,311	2,502	0.003	0.004	35.7
3~5年	3,300	10,340	3,305	0.000	0.001	15.7
10~25年	1,900	3,818	1,911	0.000	0.001	96.0
25年~	700	2,179	709	0.002	0.003	10.6
国債補完供給(5/23~5/24)						
76,772	239	239	▲0.600	▲0.600		
10,000	75	75	▲0.600	▲0.600		

マネタリーベース [億円]

5月22日時点 4,923,800

所要 [億円]

今積期の所要準備額 3,128,500

5月24日以降の残り所要

積数 13,500

平均 600

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	

国債入札予定

5月29日	40年
5月31日	2年
6月5日	10年
6月19日	30年

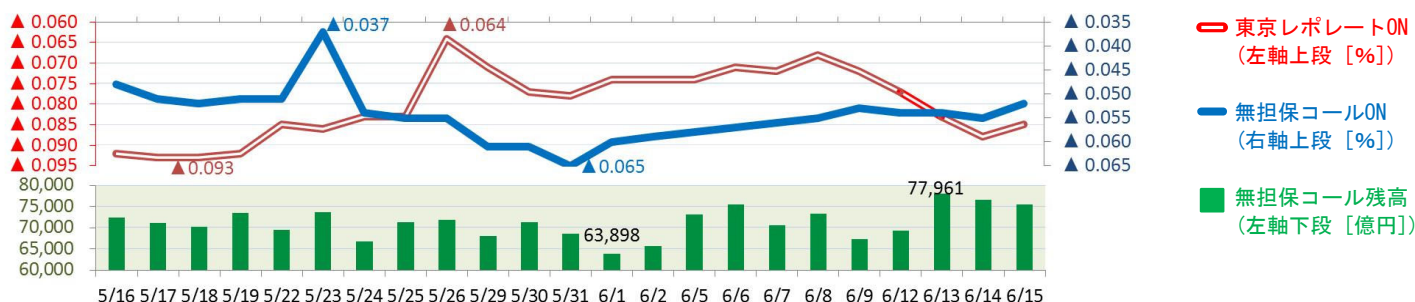
今月の国債買入オペ予定

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		
1年超3年以下	2,000~3,000 程度	2,500	7	9	14
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,300	14	18	23
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,500	25	30	5月16日
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,900	1	9	14
25年超	500~1,500 程度	700	7	11	16
物価連動債	250 程度	250	23	30	5月18日
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	月2回程度		
					5月11日
					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。

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