

短期市場の推移 [億円] [%]

	5月18日	5月21日	5月22日	5月23日
加重平均金利	▲0.064	▲0.068	▲0.068	▲0.070
東京レポレート(ON)	▲0.102	▲0.101	▲0.101	▲0.103
無コール残	73,801	69,554	67,392	66,862
ON	47,151	42,744	41,432	40,842
その他	26,650	26,810	25,960	26,020
有コール残	22,708	22,372	20,588	20,364

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25日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	櫻井審議委員、記者会見 議事要旨(5月24日)	-	17:00 (独)5月IFO企業 景況感指数 102.0
-	-	-	21:30 (米)4月耐久財 受注[前月比] -1.4%
-	-	-	FRB議長がスウェーデン中銀の カンファレンスで講演 -

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	▲0.070	▲0.102
T/N	-	-	0.000	▲0.126
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.058	0.050	▲0.025	▲0.133
2W	-	-	▲0.010	▲0.136
3W	-	-	▲0.050	▲0.137
1M	-	-	-	▲0.141
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.147
6M	-	-	-	▲0.149
1Y	-	-	-	▲0.161

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%の出合から始まった。その後は主に▲0.086%~▲0.055%の水準で取引された。同加重平均金利は前日対比横ばいの▲0.070%だった。ターム物は1W物で▲0.05%台の出合が見られた。

O/N業態別出合レンジ [%]

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

明日のマーケット

3日積みではあるものの、本日同様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 [億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月24日		5月25日		5月28日	
券		▲1,400		▲500		+1,000
財政		▲1,800		▲6,300		+4,000
過不足		▲3,200		▲6,800		+5,000
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				
共通担保(全店)					▲2,000	
CP等買入	▲400		▲200			
社債等買入			▲200			+1,000
ETF買入				+400		
国債補完供給	+300	▲300	+300			
当座預金増減		+5,000		▲6,500		+4,000
当座預金残高		3,832,500		3,826,000		3,830,000
準備預金残高		3,359,600				
積み終了先		3,356,800				
超過準備		3,356,800				
非準備先残高		472,900				
準備預金進捗率		99.7%				
平均		29.0%				
乖離率		70.6%				

5月24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
国債補完供給(5/24~5/25)	50,000	326	326	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]

5月23日時点 4,909,500

所要 [億円]

今積期の所要準備額	3,128,500
5月25日以降の残り所要積数	10,700
平均	500

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	

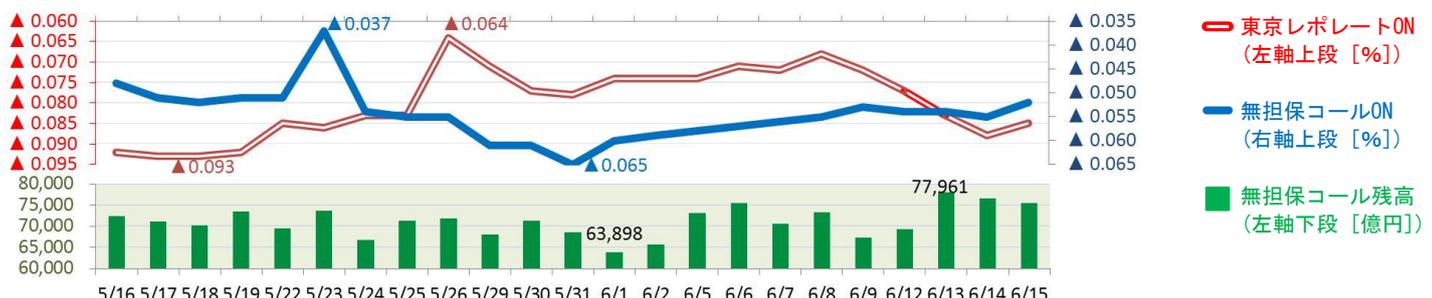
今月の国債買入オペ予定

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	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23日	1
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	1 9 14 18 25 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23日	1
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。 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