

短期市場の推移

[億円] [%]

	4月26日	5月7日	5月8日	5月9日
加重平均金利	▲0.073	▲0.070	▲0.061	▲0.048
東京レポレート(ON)	▲0.104	▲0.099	▲0.084	▲0.063
無コール残	69,535	77,287	83,182	85,509
ON	35,615	43,927	50,303	51,100
その他	33,920	33,360	32,879	34,409
有コール残	21,424	26,938	23,850	24,951

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13日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
14:00頃	消費活動指数	-	(米)クラリダFRB副議長と ボストン連銀総裁の講演	
14:00	景気動向指数(3月)	-	-	
15:00	コール市場残高(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	▲0.075	0.001	▲0.033	▲0.067
T/N	-	-	-	▲0.065
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.000	▲0.026	▲0.079
2W	-	-	0.000	▲0.092
3W	-	-	-	▲0.104
1M	-	-	▲0.020	▲0.116
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.127
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.157

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

週末3日積みとなる本日の無担保コールON物は、昨日よりも調達ニーズが強く、▲0.035%の合出から始まった。その後は主に▲0.055%~▲0.025%の水準で取引された。同加重平均金利は前営業日対比+0.015%の▲0.033%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.035 ~ ▲0.035		▲0.035 ~ ▲0.030	▲0.040 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

週明けも調達ニーズは強く、出合水準は本日と同様と予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報 5月10日	日銀予想 5月13日	当社需給予想 5月14日
券	+4,800	+4,100	+4,000
財政	▲900	▲6,600	▲7,000
過不足	+3,900	▲2,500	▲3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+5,500		
共通担保(全店)		▲4,100	+3,000
CP等買入	▲800	▲100	
国債補完供給	▲200	+200	
当座預金増減	+8,400	▲3,500	▲3,000
当座預金残高	3,945,800	3,942,300	3,939,300
準備預金残高	3,478,300	主な需給要因	
積み終了先	3,478,100	10年物価連動	
超過準備	3,478,000	国債発行	
非準備先残高	467,500	国庫短期証券	
準備預金進捗率	99.9%	発行・償還(3M)	
平均	90.0%	源泉税揚げ	
乖離率	9.9%		

5月10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	接分
国債補完供給(5/10~5/13)	65,878	211	211	▲0.500	▲0.500	
共通担保(全店)(5/13~5/27)	15,000	3,003	3,003			

マナタリーベース [億円]
5月9日時点 5,083,900

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,084,800
5月13日以降の残り所要
積数 400
平均 100

国庫短期証券入札予定

5月16日	1年	第832回
5月17日	3ヶ月	第833回
5月24日	3ヶ月	
5月31日	3ヶ月	
国債入札予定		
5月14日	30年	
5月16日	5年	
5月22日	20年	
5月28日	40年	

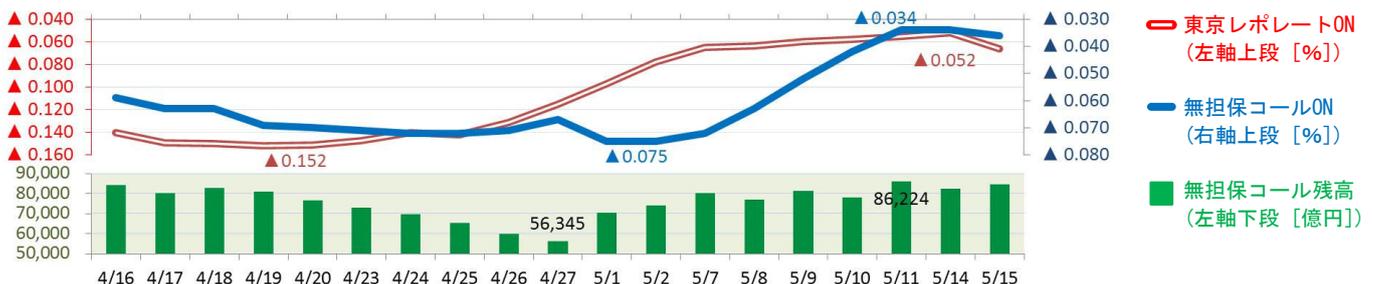
今月の国債買入オペ予定

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9日	1
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	7	13 21 27	5月7日 3
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	9	15 21 31	5月9日 3
10年超25年以下	1,000~2,500 程度	1,600	7	17 27 31	5月7日 3
25年超	100~1,000 程度	400			
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	4月17日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	4月10日	-

1年前の市場推移

○2018年4月積み期 [4月16日~5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(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会