

短期市場の推移

[億円][%]

5月20日の予定(時刻は日本時間)

	5月13日	5月14日	5月15日	5月16日
加重平均金利	▲0.028	▲0.023	▲0.025	▲0.066
東京レポレート(ON)	▲0.068	▲0.067	▲0.084	▲0.096
無コール残	79,101	79,567	78,917	80,885
ON	46,647	46,433	48,658	53,685
その他	32,454	33,134	30,259	27,200
有コール残	23,434	22,035	23,017	21,992

日本		予想	海外		予想
8:50	国内総生産(GDP)速報値 [前期比年率]	▲0.2%	17:00	(欧)3月経常収支	-
	-		21:30	(米)4月シカゴ連銀 全米活動指数	
	-			(米)FRB議長講演	-

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。

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	▲0.093
T/N	-	-	-	▲0.099
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.055	0.000	▲0.046	▲0.105
2W	▲0.050	▲0.035	▲0.041	▲0.110
3W	-	-	-	▲0.112
1M	-	-	▲0.040	▲0.118
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.129
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

本日の無担保コールON物は、▲0.080%の出合から始まった。その後は主に▲0.085%~▲0.035%の水準で取引された。週末3日積みであったが、ビッドサイドの慎重な動きは変わらず、同加重平均金利は前営業日対比▲0.002%の▲0.068%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.080	▲0.086 ~ ▲0.065	▲0.085 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

週明けも本日と同様に軟調な地合が予想される。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月17日	5月20日	5月20日	5月21日	5月21日	5月22日
券	+2,200	+2,000	+2,000	+1,000	+1,000	+1,000
財政	▲18,500	+1,200	+1,200	▲5,000	▲5,000	▲5,000
過不足	▲16,300	+3,200	+3,200	▲4,000	▲4,000	▲4,000
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				+2,200		
共通担保(全店)			▲1,500	+600		
CP等買入	▲100		▲400			+2,500
ETF買入		+700				
被災地金融機関支援	▲300	+300				
国債補完供給	+900					
当座預金増減	▲14,800		+4,100		▲1,500	
当座預金残高	3,960,800		3,964,900		3,963,400	
準備預金残高	3,457,400		主な需給要因			
積み終了先	3,434,100		国債償還			
超過準備	3,258,400		(変動15年)			
非準備先残高	503,400		国庫短期証券			
準備預金進捗率	99.2%		発行・償還			
平均	12.9%		(3M・1Y)			
乖離率	86.3%					

5月17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
国債買入(5/20~)						
10~25年	1,600	5,546	1,612	0.004	0.005	43.2
25年~	400	2,303	401	0.009	0.009	93.3
国債補完供給(5/17~5/20)						
10,000	15	15	▲0.600	▲0.600		
共通担保(全店)(5/20~6/3)						
15,000	623	623				

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
5月16日時点 5,104,600	今積期の所要準備額 3,202,100
	5月20日以降の残り所要積数 25,600
	平均 900

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

5月24日	3ヶ月	第834回
5月31日	3ヶ月	
6月6日	6ヶ月	
6月7日	3ヶ月	
国債入札予定		
5月22日	20年	
5月28日	40年	
5月30日	2年	
6月4日	10年	

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13日 2
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	9/15	21/31	5月15日 2
10年超25年以下	1,000~2,500 程度	1,600			
25年超	100~1,000 程度	400	7/17	27/31	5月17日 2
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	5月15日	1
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。