

短期市場の推移

	5月15日	5月16日	5月17日	5月20日
加重平均金利	▲0.025	▲0.066	▲0.068	▲0.068
東京レポレート(ON)	▲0.084	▲0.096	▲0.093	▲0.089
無コール残	78,917	80,885	77,130	73,956
ON	48,658	53,685	48,130	44,806
その他	30,259	27,200	29,000	29,150
有コール残	23,017	21,992	28,536	22,110

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22日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:00	営業毎旬報告 (5月20日現在)	-	17:30 (英)4月消費者物価コア指数 [前年比]	1.9%
10:30	【挨拶】原田審議委員 (長崎)	-	20:00 (米)MBA住宅ローン申請指数 [前週比]	-

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	▲0.085	0.001	▲0.065	▲0.086
T/N	-	-	-	▲0.094
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.050	▲0.094
2W	▲0.050	0.000	▲0.034	▲0.099
3W	-	-	-	▲0.101
1M	-	-	▲0.019	▲0.107
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

本日の無担保コールON物は、▲0.075%の合出から始まり、その後は主に▲0.080%~▲0.035%の水準で取引された。同加重平均金利は前営業日対比+0.003%の▲0.065%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.075	▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.085 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

本日対比で調達意欲はやや強まり、合出のレンジは小幅上昇すると予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月21日	5月22日	5月22日	5月23日	5月23日	5月23日
券	+1,900	+1,200	+1,200	+0	+0	
財政	▲6,000	▲3,800	▲3,800	▲11,000	▲11,000	
過不足	▲4,100	▲2,600	▲2,600	▲11,000	▲11,000	
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				+5,000		
国債買入				+12,800		
CP等買入	▲100	+2,500	▲200			
社債等買入			▲200			
ETF買入		+400		+300		
国債補完供給	+100	▲900	+900			
当座預金増減	▲2,100	+16,000	+16,000	▲11,000	▲11,000	
当座預金残高	3,965,400	3,981,400	3,981,400	3,970,400	3,970,400	
準備預金残高	3,465,000					
積み終了先	3,461,600					
超過準備	3,461,100					
非準備預金残高	500,400					
準備預金進捗率	99.6%					
平均	19.4%					
乖離率	80.3%					

5月21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
国庫短期証券買入(5/22~)	5,000	15,083	5,001	0.006	0.008	97.2
国債買入(5/22~)						
1~3年	3,500	13,588	3,516	0.003	0.004	25.2
3~5年	4,000	10,049	4,006	0.002	0.003	35.9
5~10年	4,800	9,837	4,808	0.002	0.003	57.7
物価連動	250	1,134	254	▲0.010	▲0.042	55.6
米ドル資金供給(5/23~5/31)	0	0	2,880	2,880		
社債等買入(5/27~)	1,000	1,705	1,000	0.000	0.012	76.4
国債補完供給(5/21~5/22)	72,942	908	908	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要
5月20日時点 5,092,300	今積期の所要準備額 3,202,100
	5月22日以降の残り所要積数 12,000
	平均 500

国庫短期証券入札予定

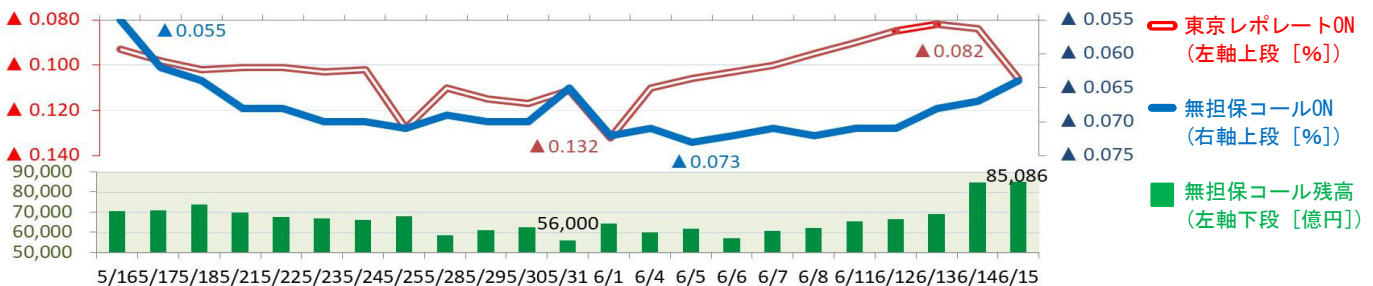
5月24日	3ヶ月	第834回
5月31日	3ヶ月	
6月6日	6ヶ月	
6月7日	3ヶ月	
5月22日	20年	
5月28日	40年	
5月30日	2年	
6月4日	10年	

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21日	1
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	9/15/21/31	5月21日	1
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21日	0
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。 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