

短期市場の推移

[億円] [%]

	5月16日	5月17日	5月20日	5月21日
加重平均金利	▲0.066	▲0.068	▲0.068	▲0.065
東京レポレート(ON)	▲0.096	▲0.093	▲0.089	▲0.086
無コール残	80,885	77,130	73,956	78,918
ON	53,685	48,130	44,806	48,318
その他	27,200	29,000	29,150	30,600
有コール残	21,992	28,536	22,110	22,567

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。

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	▲0.080	0.001	▲0.058	▲0.084
T/N	-	-	-	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.001	▲0.092
2W	▲0.050	▲0.020	▲0.030	▲0.095
3W	▲0.041	0.000	▲0.028	▲0.098
1M	-	-	-	▲0.105
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.124
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.156

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

5月23日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
-	【記者会見】原田審議委員 (5月22日)	-	21:30	(米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
-	-	-	22:45	(米)5月製造業PMI	53.0
-	-	-	23:00	(米)4月新築住宅販売件数	67.7万戸

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は、▲0.065%の出合から始まり、その後は主に▲0.070%～▲0.035%の水準で取引された。昨日と比べてビッドサイドの資金調達ニーズが強く、同加重平均金利は前営業日対比+0.007%の▲0.058%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.065		▲0.055 ~ ▲0.050	▲0.070 ~ ▲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、出合のレンジは小幅上昇すると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報 5月22日	日銀予想 5月23日	当社需給予想 5月24日
券	+1,100	▲200	▲1,000
財政	▲5,500	▲9,500	▲2,000
過不足	▲4,400	▲9,700	▲3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+5,000	
国債買入		+12,800	
CP等買入	▲200	▲100	
社債等買入	▲200		
ETF買入		+300	
国債補完供給	+900	▲200	+200
当座預金増減	+14,000	▲9,600	▲3,000
当座預金残高	3,979,400	3,969,800	3,966,800
準備預金残高	3,478,400	主な需給要因	
積み終了先	3,475,500		
超過準備	3,475,500	国債発行 (20年)	
非準備預金残高	501,000		
準備預金進捗率	99.7%		
平均	22.6%		
乖離率	77.1%		

5月22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(5/22~5/23)	28,476	172	172	▲0.600	▲0.600
-------------------	--------	-----	-----	--------	--------

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
5月21日時点 5,088,200	今積期の所要準備額 3,202,100
	5月23日以降の残り所要
	積数 9,100
	平均 400

国庫短期証券入札予定

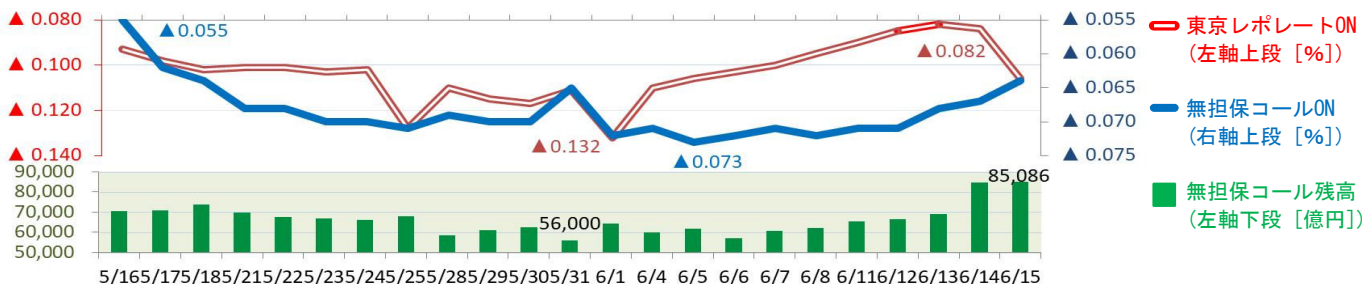
5月24日	3ヶ月	第834回
5月31日	3ヶ月	
6月6日	6ヶ月	
6月7日	3ヶ月	
国債入札予定		
5月28日	40年	
5月30日	2年	
6月4日	10年	
6月13日	30年	

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9日	1
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500	7 13 21 27	5月21日	1
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	9 15 21 31	5月21日	1
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	7 17 27 31	5月17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			
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