



短期市場の推移

	5月12日	5月13日	5月14日	5月17日
加重平均金利	▲0.016	▲0.014	▲0.011	▲0.015
東京レボレート(TN)	▲0.087	▲0.085	▲0.085	▲0.090
無コール残	140,292	134,505	111,643	132,549
ON	85,689	80,492	64,290	81,761
その他	54,603	54,013	47,353	50,788
有コール残	20,197	21,523	19,732	20,706

加重平均金利、コール残高は日銀、東京レボ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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.070	0.001	▲0.016	▲0.087
T/N	▲0.008	▲0.001	▲0.003	▲0.092
S/N	-	-	▲0.011	-
1W	-	-	▲0.012	▲0.092
2W	▲0.004	▲0.001	▲0.003	▲0.094
3W	-	-	0.150	▲0.096
1M	▲0.005	▲0.003	▲0.004	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.103
6M	-	-	-	▲0.116
1Y	-	-	-	▲0.136

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

5月19日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
13:30	3月の鉱工業生産確報 (経産省)		(米)FOMC議事録 (4月27~28日分)	
	-		(欧)4月の消費者物価確報	
	-		-	

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▲0.015%の出合から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.005%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.016%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.020	▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.025 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

調達ニーズに大きな変化はなく、出合いの水準は本日対比で横ばいと予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	5月18日	5月19日	5月19日	5月20日	5月20日
券	+1,100	+400	+400	+0	+0
財政	+2,900	+0	+0	▲39,000	▲39,000
過不足	+4,000	+400	+400	▲39,000	▲39,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+10,000		
CP等買入	▲200		▲100	+4,000	
E T F買入				+400	
国債補完供給		▲200	+200		
当座預金増減	+3,600	+14,900	+14,900	▲39,000	▲39,000
当座預金残高	5,273,500	5,288,400	5,288,400	5,249,400	5,249,400
準備預金残高	4,626,400				
積み終了先	4,623,500				
超過準備	4,609,600				
非準備先残高	647,100				
準備預金進捗率	99.7%				
平均	9.7%				
乖離率	90.1%				

5月18日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(5/19~)	10,000	26,576	10,002	0.006	0.006	90.6
米ドル資金供給(5/20~5/27)	0	0	0.310	0.310		
米ドル資金供給(5/20~8/12)	0	0	0.320	0.320		
国債補完供給(5/18~5/19)	183	183	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース (億円)
5月17日時点 6,479,900

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,743,300
5月19日以降の残り所要	
積数	9,600
平均	300

国庫短期証券入札予定

5月19日	1年	第994回
5月21日	3ヶ月	第995回
5月24日	6ヶ月	第996回
5月28日	3ヶ月	

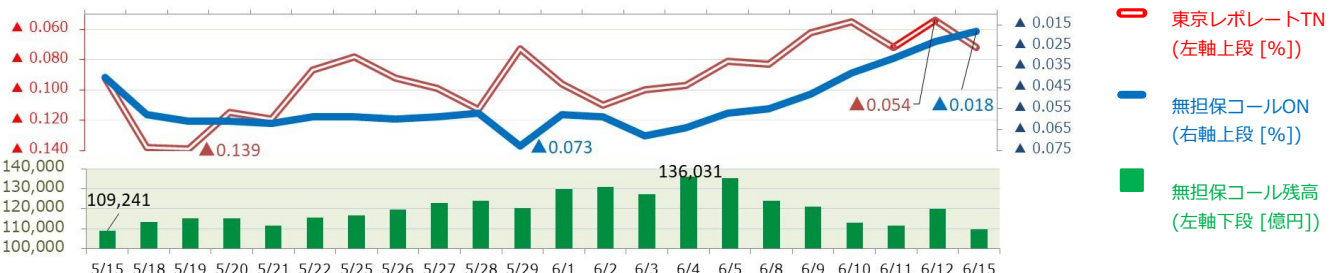
今月の国債買入オペ予定

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	1500	1,500	月1回程度	4月5日	1
1年超3年以下	4750	4,750	10 14 20 24	5月14日	2
3年超5年以下	4500	4,500	10 14 24 28	5月14日	2
5年超10年以下	4500	4,500	6 14 20 28	5月14日	2
10年超25年以下	2000	2,000	6	5月6日	0
25年超	500	500	20	4月19日	1
物価連動債	600	600	月1回程度	4月7日	1
変動利付債<四半期>	300	300	-	4月21日	-

1年前の市場推移

○2020年5月積み期 [5月15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