



短期市場の推移

	5月13日	5月14日	5月17日	5月18日
加重平均金利	▲0.014	▲0.011	▲0.015	▲0.016
東京レボレート(TN)	▲0.085	▲0.085	▲0.090	▲0.092
無コール残	134,505	111,643	132,549	140,947
ON	80,492	64,290	81,761	84,739
その他	54,013	47,353	50,788	56,208
有コール残	21,523	19,732	20,706	20,597

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	▲0.096
T/N	▲0.008	▲0.001	▲0.003	▲0.091
S/N	-	-	▲0.011	-
1W	▲0.012	▲0.006	▲0.008	▲0.093
2W	▲0.011	▲0.005	▲0.008	▲0.094
3W	▲0.011	0.140	0.039	▲0.096
1M	-	-	▲0.007	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.104
6M	-	-	-	▲0.115
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20日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	4月 貿易統計 (財務省)	1,439億円	17:00	(欧) 3月 経常収支	-
8:50	3月 機械受注 (内閣府)	5.5%	21:30	(米) 週間 新規失業保険申請件数	-
			21:30	(米) 5月 フィデリティ連銀製造業指数	43.2

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)は前営業日対比横ばいの▲0.016%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.015	▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.025 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

オファーサイド・ビッドサイドの動向に大きな変化はなく、出合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19日	5月20日	5月20日	5月21日	5月21日	5月22日
券	+400	▲100	▲100	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	+1,000	▲32,500	▲32,500	+8,000	+8,000	+8,000
過不足	+1,400	▲32,600	▲32,600	+7,000	+7,000	+7,000
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		+10,000				
CP等買入	▲100	+4,000	▲700			
E T F買入		+400				
国債補完供給	+200	▲500	+500			
当座預金増減	+15,400	▲32,800	▲32,800	+7,000	+7,000	+7,000
当座預金残高	5,288,900	5,256,100	5,256,100	5,263,100	5,263,100	5,263,100
準備預金残高	4,635,000	4,633,200	4,633,200	4,632,800	4,632,800	4,632,800
積み終了先						
超過準備	4,632,800	4,632,800	4,632,800	4,632,800	4,632,800	4,632,800
非準備先残高	653,900	653,900	653,900	653,900	653,900	653,900
準備預金進捗率	99.8%	99.8%	99.8%	99.8%	99.8%	99.8%
平均	12.9%	12.9%	12.9%	12.9%	12.9%	12.9%
乖離率	86.9%	86.9%	86.9%	86.9%	86.9%	86.9%

5月19日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(5/19~5/20)	539	539	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
5月18日時点 6,482,500

所要	今積期の所要準備額	5月20日以降の残り所要
	3,743,300	
積数	7,400	
平均	300	

国庫短期証券入札予定

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
6月4日	3ヶ月

国債入札予定

5月21日	20年
5月27日	40年
5月31日	2年
6月3日	10年

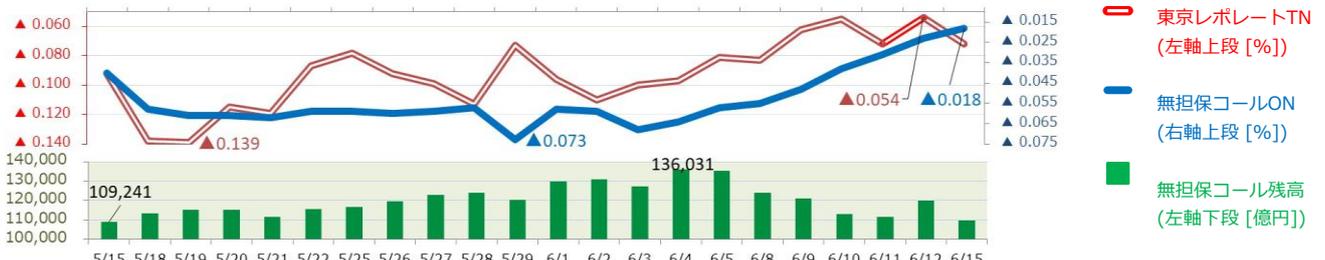
今月の国債買入オペ予定

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	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