



短期市場の推移

	5月13日	5月14日	5月15日	5月18日
加重平均金利	0.727	0.727	0.727	0.728
東京レボレート(TN)	0.754	0.754	0.754	0.755
無コール残	87,423	88,286	87,871	87,318
ON	29,914	31,757	31,392	30,309
その他	57,509	56,529	56,479	57,009
有コール残	25,381	25,831	26,343	25,942

[億円] [%]

5月20日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) FOMC議事録 (4月28~29日)	-
-	-	(欧) ユーロ圏CPI (確報、4月)	-
-	-	-	-

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	0.700	0.775	0.728	0.751
T/N	-	-	0.780	0.755
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.731	0.750
2W	-	-	-	0.750
3W	-	-	-	0.750
1M	-	-	-	0.764
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.893
6M	-	-	-	0.954
1Y	-	-	-	1.104

本日の市況

無担保コールON物は0.727%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.728%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.727 ~ 0.727	0.727 ~ 0.727

翌営業日のマーケット

出合いの水準は本日対比横ばい圏を予想する。

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

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
券		+800	+200	+500	
財政		▲35,600	+5,900	▲6,000	
過不足		▲34,800	+6,100	▲5,500	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	スタート
国債補完供給	+1,000	▲600	+600		
当座預金増減		▲34,400	+6,700	▲5,500	
当座預金残高		4,498,900	4,505,600	4,500,100	
準備預金残高		4,187,700	主な需給要因		
積み終了先		4,154,500	国庫短期証券発行償還	国債発行(20年)	
超過準備		4,142,100	(1Y)		
非準備先残高		311,200			
準備預金進捗率		98.6%			
平均		12.9%			
乖離率		85.7%			

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)	744	744	0.550	0.550		
	0	0				

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

マナタリーベース [億円]
5月18日時点 5,734,400

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,197,500
5月20日以降の残り所要	
積数	56,800
平均	2,100

国庫短期証券入札予定

5月22日	3ヶ月(第1383回)
5月29日	3ヶ月
6月5日	3ヶ月
6月9日	6ヶ月
国債入札予定	
5月20日	20年
5月25日	5年クワイメート・トランジション
5月27日	40年
5月29日	2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	1000	1,000	11		5月11日 0
1年超3年以下	2550	2,550	11 15 21		5月15日 1
3年超5年以下	2300	2,300	11 21 28		5月11日 2
5年超10年以下	2400	2,400	15 21 28		5月15日 2
10年超25年以下	800	800	11 15 28		5月15日 1
25年超	750	750	11 21		5月11日 1
物価連動債	400	400	28		4月23日 1
変動利付債	-	300	-		4月14日 -

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