



短期市場の推移

	4月27日	4月28日	4月30日	5月6日
加重平均金利	▲0.013	▲0.014	▲0.017	▲0.016
東京レポレート(TN)	▲0.096	▲0.103	▲0.099	▲0.089
無コール残	152,962	153,454	146,716	131,989
ON	96,049	97,081	94,468	80,126
その他	56,913	56,373	52,248	51,863
有コール残	21,905	21,460	21,521	19,224

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
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.080	0.001	▲0.016	▲0.081
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.003	▲0.083
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	▲0.005	▲0.010	▲0.088
2W	▲0.009	0.095	0.034	▲0.091
3W	▲0.013	0.001	▲0.011	▲0.094
1M	▲0.018	▲0.006	▲0.011	▲0.098
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.105
6M	-	-	-	▲0.116
1Y	-	-	-	▲0.137

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10日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) シカゴ連銀総裁講演	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.010%の合出から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.005%の水準で合出が見られた。3日積みであったものの、ビッドサイドの様子見姿勢が強く、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
▲0.040 ~ ▲0.015	▲0.030 ~ ▲0.018	▲0.035 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

週初も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横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月7日	5月10日	5月7日	5月10日	5月11日	5月11日
券	+3,100	+2,100	+3,100	+2,100	+2,000	+2,000
財政	▲32,800	▲9,700	▲32,800	▲9,700	+5,000	+5,000
過不足	▲29,700	▲7,600	▲29,700	▲7,600	+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
国債買入		+7,000				
CP等買入	▲100					
国債補完供給	+300	▲400	+400			
当座預金増減	▲22,900	▲7,200	▲22,900	▲7,200	+7,000	+7,000
当座預金残高	5,277,800	5,270,600	5,277,800	5,270,600	5,277,600	5,277,600
準備預金残高	4,644,800		4,644,800			
積み終了先	4,644,800		4,644,800			
超過準備	4,644,800		4,644,800			
非準備先残高	633,000		633,000			
準備預金進捗率	99.9%		99.9%			
平均	80.0%		80.0%			
乖離率	19.9%		19.9%			

5月7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(5/7~5/10)	379	379	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

※米ドル資金供給は百万\$

マネタリーベース (億円)
5月6日時点 6,521,700

所要	今積期の所要準備額	3,599,500
5月10日以降の残り所要	積数	100
	平均	0

国庫短期証券入札予定

5月14日	3ヶ月	第993回
5月19日	1年	
5月21日	3ヶ月	
5月24日	6ヶ月	

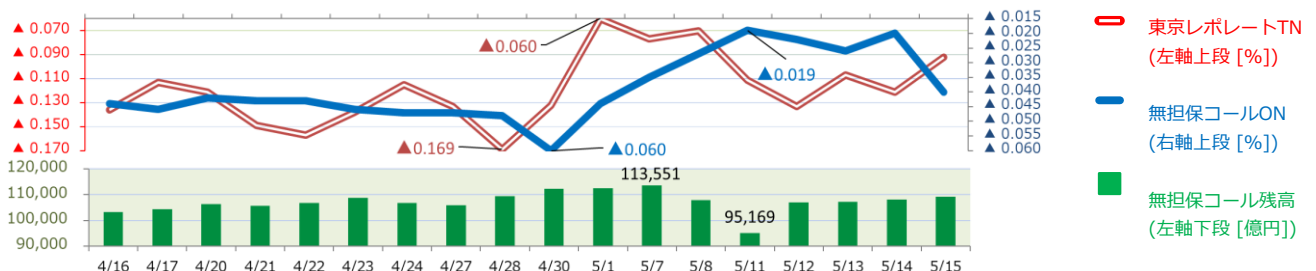
今月の国債買入オペ予定

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	4月26日	4
3年超5年以下	4500	4,500	10 14 24 28	4月26日	4
5年超10年以下	4500	4,500	6 14 20 28	5月6日	3
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4月積み期 [4月16日~5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