



短期市場の推移

	5月7日	5月10日	5月11日	5月12日
加重平均金利	▲0.016	▲0.016	▲0.015	▲0.016
東京レポレート(TN)	▲0.083	▲0.085	▲0.091	▲0.087
無コール残	134,331	141,165	131,217	140,292
ON	82,333	90,932	78,034	85,689
その他	51,998	50,233	53,183	54,603
有コール残	19,498	19,469	19,522	20,197

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	▲0.070	0.001	▲0.014	▲0.082
T/N	-	-	▲0.001	▲0.085
S/N	-	-	▲0.011	-
1W	▲0.010	▲0.009	▲0.009	▲0.090
2W	▲0.015	▲0.003	▲0.008	▲0.091
3W	-	-	▲0.010	▲0.096
1M	▲0.010	0.000	▲0.008	▲0.099
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.005	▲0.104
6M	-	-	-	▲0.115
1Y	-	-	-	▲0.136

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14日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) 4月 小売売上高	-
-	-	(米) 4月 鉱工業生産・稼働率	-
-	-	(米) 5月ミシガン大学消費者信頼感指数(速報)	-

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▲0.010%の合出から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.005%の水準で合出が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.014%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.015	▲0.018 ~ ▲0.018	▲0.020 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

週末3日積みの一部が来積み期となるが、出合水準は本日対比横ばいを予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月13日		5月14日		5月17日	
券	+700		+1,100		+1,000	
財政	+3,800		▲6,800		▲4,000	
過不足	+4,500		▲5,700		▲3,000	
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
CP等買入	▲100		▲1,100			
社債等買入			+1,300			
被災地金融機関支援			▲400		+300	
国債補完供給	+100					
当座預金増減	+4,500		▲5,600		▲3,000	
当座預金残高	5,264,800		5,259,200		5,256,200	
準備預金残高	4,632,100		主な需給要因			
積み終了先	4,632,100		国債発行(30年)		国庫短期証券発行・償還(3M)	
超過準備	4,632,100				国債発行・償還(個人向け)	
非準備先残高	632,700					
準備預金進捗率	100.0%					
平均乖離率	93.3%					
乖離率	6.7%					

5月13日のオペ結果

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国債補完供給(5/13~5/14)

9	9	▲0.350	▲0.350
0	0		

マネタリーベース (億円)

5月12日時点 6,473,400

所要

今積期の所要準備額	3,597,100
5月14日以降の残り所要	
積数	0
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 第994回
5月21日	3ヶ月
5月24日	6ヶ月

国債入札予定

5月17日	物価運動
5月19日	5年
5月21日	20年
5月27日	40年

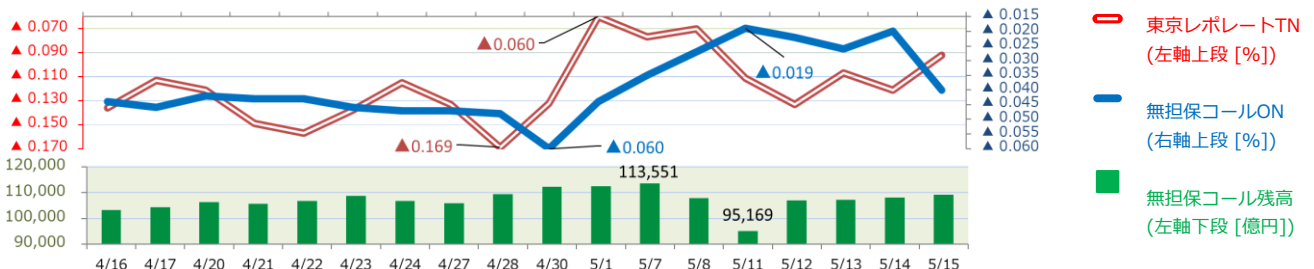
今月の国債買入オペ予定

オベ種類	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10日	3
3年超5年以下	4500	4,500	10 14 24 28	5月10日	3
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
物価運動債	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