



短期市場の推移

[億円] [%]

	4月26日	4月27日	4月28日	5月2日
加重平均金利	▲0.017	▲0.018	▲0.021	▲0.020
東京レボレート(TN)	▲0.159	▲0.191	▲0.148	▲0.133
無コール残	172,327	182,035	179,140	190,582
ON	88,369	106,382	108,002	120,154
その他	83,958	75,653	71,138	70,428
有コール残	22,237	22,713	19,644	29,241

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	▲0.065	0.001	▲0.019	▲0.107
T/N	▲0.010	▲0.008	▲0.009	▲0.115
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.010	▲0.024	▲0.122
2W	▲0.020	▲0.012	▲0.017	▲0.122
3W	-	-	0.170	▲0.127
1M	-	-	0.150	▲0.125
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.125
6M	-	-	-	▲0.114
1Y	-	-	-	▲0.112

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

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	5月6日	5月9日	5月10日
券	+2,200	+1,900	+2,000
財政	▲26,000	▲40,100	+1,000
過不足	▲23,800	▲38,200	+3,000
金融調節	エンド	エンド	エンド
CP等買入	▲100	▲400	-
ETF買入	-	+200	-
国債補完供給	+9,300	+10,600	-
当座預金増減	▲25,200	▲27,800	+3,000
当座預金残高	5,574,400	5,546,600	5,549,600
準備預金残高	4,890,300	4,890,300	4,890,300
積み終了先	4,890,300	4,890,300	4,890,300
超過準備	4,890,300	4,890,300	4,890,300
非準備先残高	684,100	684,100	684,100
準備預金進捗率	99.9%	99.9%	99.9%
平均	76.7%	76.7%	76.7%
乖離率	23.2%	23.2%	23.2%

5月6日のオペ結果

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
------	------	----	----	----	----	----

国債補完供給(5/6~5/9)

10,644 10,644 ▲0.350 ▲0.385

0 0

国債買入(固定利回り方式)(残存5年超10年以下)(5/9~)

0 0

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.018%の合出から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.015%の水準で取引された。出合の水準に大きな変化はなく、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.019%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.028 ~ ▲0.027	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.025 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

出合の水準は本日と横ばいを予想。

国庫短期証券入札予定

5月9日	6ヶ月(第1078回)
5月13日	3ヶ月(第1079回)
5月19日	1年
5月20日	3ヶ月

国債入札予定

5月10日	10年
5月12日	30年
5月16日	物価連動
5月18日	5年

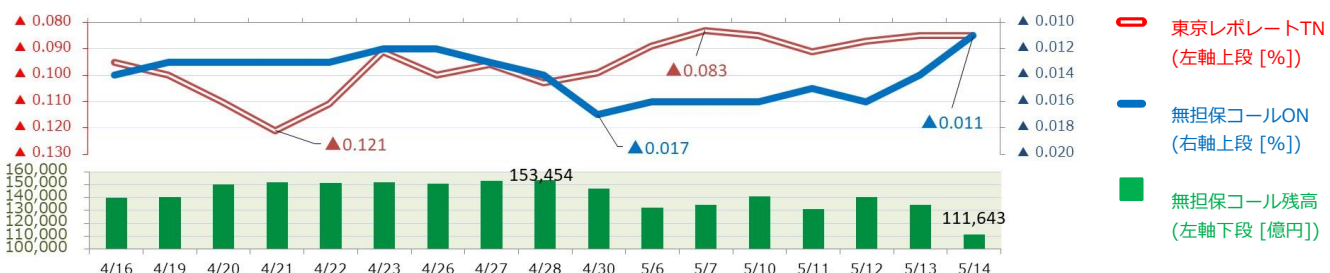
今月の国債買入オペ予定

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	4月4日	1
1年超3年以下	4750	4,750	9 13 19 25	4月20日	4
3年超5年以下	4750	4,750	9 13 25 30	4月26日	4
5年超10年以下	5000	5,000	13 19 25 30	4月26日	4
10年超25年以下	1250	1,250	9 25	4月20日	2
25年超	500	500	19 30	4月26日	2
物価連動債	600	600	月1回	4月26日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	4月8日	-

1年前の市場推移

○2021年4月積み期 [4月16日~5月14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