



短期市場の推移

[億円] [%]

	4月27日	4月28日	5月2日	5月6日
加重平均金利	▲0.018	▲0.021	▲0.020	▲0.019
東京レボレート(TN)	▲0.191	▲0.148	▲0.133	▲0.115
無コール残	182,035	179,140	190,582	190,163
ON	106,382	108,002	120,154	119,520
その他	75,653	71,138	70,428	70,643
有コール残	22,713	19,644	29,241	26,989

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	▲0.060	0.001	▲0.017	▲0.087
T/N	▲0.010	▲0.008	▲0.009	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	▲0.010	▲0.031	▲0.093
2W	▲0.024	▲0.008	▲0.021	▲0.101
3W	-	-	-	▲0.104
1M	-	-	-	▲0.112
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.119
6M	-	-	-	▲0.113
1Y	-	-	-	▲0.111

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10日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-		-	
-		-	
-		-	

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%の合出から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.010%の水準で取引された。前営業日と比べビッドサイドの資金調達ニーズが強くなり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.017%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.025 ~ ▲0.010

登営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの資金調達ニーズが強いことが予想されるため、出合水準は本日対比やや上昇を想定。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	5月9日	5月10日	5月11日
券	+2,100	+2,400	+0
財政	▲35,100	+3,600	▲16,000
過不足	▲33,000	+6,000	▲16,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+12,300
共通担保(全店)			▲4,500
CP等買入	▲400	▲300	
E T F 買入	+200		
国債補充供給	+10,800	+10,700	
	▲10,700		
当座預金増減	▲33,100	+28,700	▲20,500
当座預金残高	5,541,300	5,570,000	5,549,500
準備預金残高	4,871,300		
積み終了先	4,871,200		
超過準備	4,871,200		
非準備先残高	670,000		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	80.0%		
乖離率	20.0%		

5月9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

国債買入(固定利回り方式)(5/10~)

5~10年 0 0

国債買入(5/10~)

~1年	1,500	5,736	1,501	0.004	0.005	9.8
1~3年	4,750	8,208	4,752	▲0.002	0.001	3.9
3~5年	4,750	8,787	4,752	▲0.002	0.000	63.5
10~25年	1,250	4,048	1,257	0.011	0.012	19.8

国債補充供給(5/9~5/10)

10,558	10,558	▲0.350	▲0.369
76	76	▲0.350	▲0.350

マネタリーベース [億円]

5月6日時点 6,834,200

所要

[億円]

今積期の所要準備額 3,709,200

5月10日以降の残りの所要

積数 0

平均 0

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

[億円]

5月13日	3ヶ月(第1079回)
5月19日	1年
5月20日	3ヶ月
5月24日	6ヶ月

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

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	5月9日	0
1年超3年以下	4750	4,750	9 13 19 25	5月9日	3
3年超5年以下	4750	4,750	9 13 25 30	5月9日	3
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	5月9日	1
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