



短期市場の推移

	4月28日	5月2日	5月6日	5月9日
加重平均金利	▲0.021	▲0.020	▲0.019	▲0.017
東京レボレート(TN)	▲0.148	▲0.133	▲0.115	▲0.086
無コール残	179,140	190,582	190,163	149,116
ON	108,002	120,154	119,520	79,523
その他	71,138	70,428	70,643	69,593
有コール残	19,644	29,241	26,989	32,046

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	▲0.050	0.001	▲0.013	▲0.088
T/N	-	-	▲0.008	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.005	▲0.012	▲0.096
2W	▲0.015	▲0.010	▲0.013	▲0.101
3W	-	-	▲0.015	▲0.105
1M	▲0.023	▲0.010	▲0.017	▲0.110
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.117
6M	-	-	-	▲0.112
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11日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
14:00	3月景気動向指数 (速報)		20:00	(米)週間MBA住宅ローン申請件数
14:00	3月消費活動指数		21:30	(米)4月消費者物価コア指数 [前年比]
15:00	4月コール市場残高		-	-

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%の出合から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.010%の水準で取引された。前営業日に引き続きビッドサイドの資金調達ニーズが強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.004%の▲0.013%となった。また日本銀行は5月積み期におけるマクロ加算残高算出に用いる基準比率を14.0%に定めることとした。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.015 ~ ▲0.012	▲0.010 ~ ▲0.008	▲0.017 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

引き続き資金調達ニーズは旺盛だと思われるため、堅調な地合を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	5月10日	5月11日	5月11日	5月12日	5月12日
券	+2,500	+2,500	+2,500	+1,000	
財政	+3,500	▲18,600	▲18,600	▲2,000	
過不足	+6,000	▲16,100	▲16,100	▲1,000	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入		+12,300			
共通担保(全店)			▲4,500	+5,100	
CP等買入	▲300		▲500		
国債補充供給	+10,700	▲12,000	+12,000		
当座預金増減		+16,700	▲4,000	▲1,000	
当座預金残高		5,558,000	5,554,000	5,553,000	
準備預金残高		4,884,400			
積み終了先		4,884,400	国債発行(10年)	源泉税揚げ	
超過準備		4,884,400			
非準備先残高		673,600			
準備預金進捗率		100.0%			
平均		83.3%			
乖離率		16.7%			

5月10日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(固定利回り方式)(5/11~)						
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(5/12~5/19)						
	0	0	1,090	1,090		
国債補充供給(5/10~5/11)						
	11,974	11,974	▲0.350	▲0.364		
	0	0				
共通担保(全店)(5/11~5/25)						
	20,000	5,050	5,050			

マナタリーベース [億円]
5月9日時点 6,799,100

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,732,400
5月11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12日	30年
5月16日	物価連動
5月18日	5年
5月20日	20年

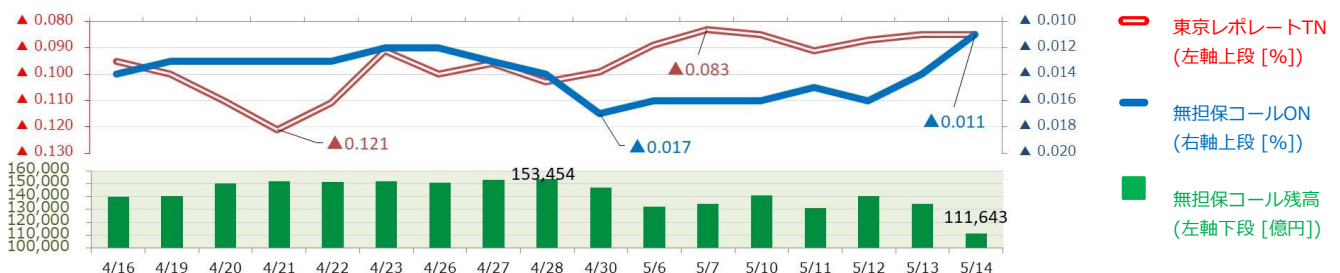
今月の国債買入オペ予定

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	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