



短期市場の推移

[億円] [%]

	5月2日	5月6日	5月9日	5月10日
加重平均金利	▲0.020	▲0.019	▲0.017	▲0.013
東京レボレート(TN)	▲0.133	▲0.115	▲0.086	▲0.087
無コール残	190,582	190,163	149,116	151,270
ON	120,154	119,520	79,523	81,267
その他	70,428	70,643	69,593	70,003
有コール残	29,241	26,989	32,046	30,910

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 東京レボレート
	最低	最高	平均	
O/N	▲0.045	0.001	▲0.009	▲0.094
T/N	-	-	▲0.008	▲0.098
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.030	▲0.102
2W	▲0.013	0.170	0.012	▲0.106
3W	-	-	-	▲0.108
1M	▲0.020	▲0.010	▲0.013	▲0.115
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.118
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12日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	3月国際収支(経常収支)	17500億円	15:00	(英)1-3月期国内総生産(GDP)速報値[前年比]
8:50	日銀金融政策決定会合における主な意見(4月27・28日)		21:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分]
	-		21:30	(米)4月生産者物価コア指数[前年比]

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▲0.008%の合出から始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.005%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調達ニーズが強かったことに加え、オフアーサイドの運用ニーズが減退したことで、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.004%の▲0.009%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.010	▲0.007 ~ ▲0.005	▲0.010 ~ ▲0.005

登営業日のマーケット

調達ニーズが横ばいとなるに対し、運用資金は減退が続き、合出の水準は本日対比上昇と予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	5月11日	5月12日	5月13日
券	+2,500	+1,300	+1,000
財政	▲22,100	▲6,400	▲6,000
過不足	▲19,600	▲5,100	▲5,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			
共通担保(全店)	▲4,500	+5,100	
CP等買入	▲500	▲200	
国債補完供給	+12,000	+2,600	
当座預金増減	▲10,100	+2,300	▲5,000
当座預金残高	5,547,900	5,550,200	5,545,200
準備預金残高	4,876,900	主な需給要因	
積み終了先	4,876,900		
超過準備	4,876,900		
非準備先残高	671,000		
準備預金進捗率	100.0%	源泉税揚げ	国債発行(30年)
平均	86.7%		
乖離率	13.3%		

5月11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

国庫短期証券買入(5/12~)	5,000	15,666	5,001	0.011	0.011	85.6
国債買入(固定利回り方式)(5/12~)						
5~10年	0	0				
国債補完供給(5/11~5/12)	2,577	2,577	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

5月10日時点 6,813,300

所要

今積期の所要準備額 3,732,400

5月12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

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	4,750	4,750	9 13 19 25	5月9日	3
3年超5年以下	4,750	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	-

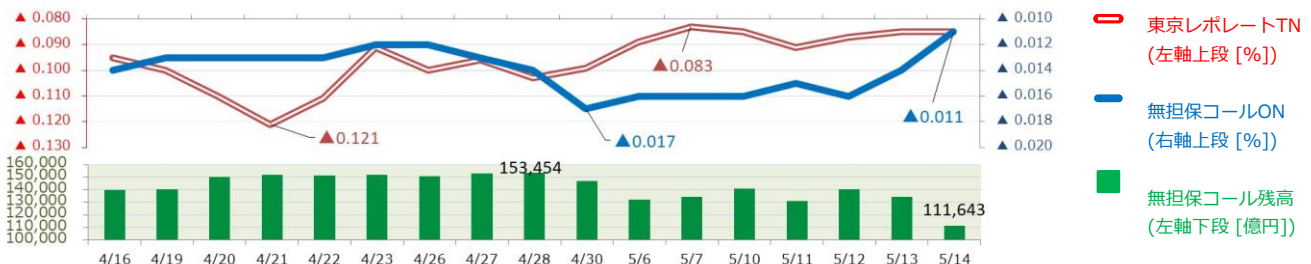
国債入札予定

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

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