



## デイリーシグナル

2022年5月12日(木)

### 短期市場の推移

	5月6日	5月9日	5月10日	5月11日
加重平均金利	▲0.019	▲0.017	▲0.013	▲0.009
東京レポレート(TN)	▲0.115	▲0.086	▲0.087	▲0.098
無コール残	190,163	149,116	151,270	138,069
ON	119,520	79,523	81,267	70,496
その他	70,643	69,593	70,003	67,573
有コール残	26,989	32,046	30,910	29,843

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	▲0.045	0.001	▲0.007	▲0.092
T/N	-	-	-	▲0.098
S/N	-	-	-	-
1W	0.000	0.280	0.163	▲0.102
2W	▲0.020	▲0.005	▲0.014	▲0.108
3W	-	-	-	▲0.110
1M	▲0.030	▲0.015	▲0.019	▲0.115
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.117
6M	-	-	-	▲0.113
1Y	-	-	-	▲0.111

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13日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	18:00 (欧)3月鉱工業生産指数[前月比]	-
-	-	23:00 (米)5月ミシガン大学消費者信頼感指数速報	63.7
-	-	-	-

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▲0.005%の合出から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.003%の水準で取引された。昨日以上にビッドサイドの資金調達意欲が強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.007%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.005	▲0.005 ~ ▲0.003	▲0.010 ~ ▲0.003

### 登営業日のマーケット

積み最終日、3日積みではあるものの、出合の水準は本日と同水準と予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月12日		5月13日		5月16日	
券	+1,400		+1,800		+0	
財政	▲4,800		▲8,500		▲14,000	
過不足	▲3,400		▲6,700		▲14,000	
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
国庫短期証券買入	+5,000					
CP等買入	▲200		▲500			
国債補完供給	+2,600		+4,100			
当座預金増減	▲100		▲3,100		▲14,000	
当座預金残高	5,547,800		5,544,700		5,530,700	
準備預金残高	4,872,800		4,872,800		主な需給要因	
積み終了先	4,872,800		国債発行(30年)		国庫短期証券	
超過準備	4,872,700				発行・償還(3M)	
非準備先残高	675,000					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	90.0%					
乖離率	10.0%					

### 5月12日のオペ結果

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国債買入(固定利回り方式)(5/13~)	5~10年 0 0					
CP等買入(5/17~)	4,000	8,178	3,979	▲0.003	▲0.002	13.3
国債補完供給(5/12~5/13)	4,037	4,037	▲0.350	▲0.350		
	55	55	▲0.350	▲0.355		

マネタリーベース (億円)  
5月11日時点 6,800,700

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,732,400
5月13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(第1080回)
5月20日	3ヶ月
5月24日	6ヶ月

### 国債入札予定

5月16日	物価運動
5月18日	5年
5月20日	20年
5月26日	40年

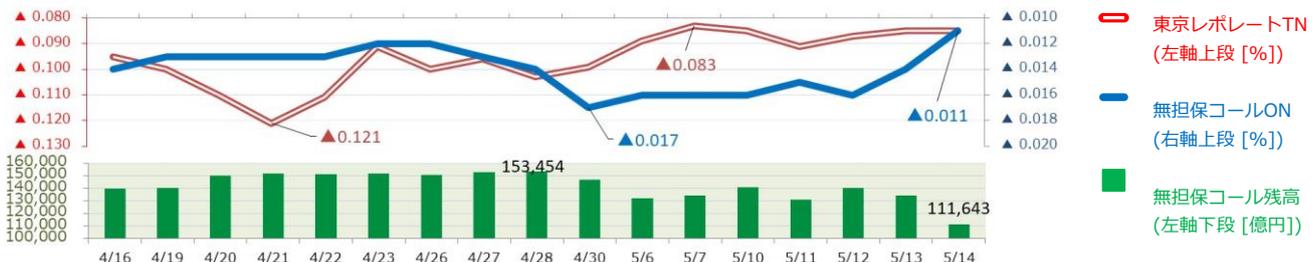
### 今月の国債買入オペ予定

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	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
物価運動債	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