



短期市場の推移

	5月9日	5月10日	5月11日	5月12日
加重平均金利	▲0.017	▲0.013	▲0.009	▲0.007
東京レボレート(TN)	▲0.086	▲0.087	▲0.098	▲0.098
無コール残	149,116	151,270	138,069	141,164
ON	79,523	81,267	70,496	73,341
その他	69,593	70,003	67,573	67,823
有コール残	32,046	30,910	29,843	30,747

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	▲0.045	0.001	▲0.005	▲0.089
T/N	▲0.010	▲0.008	▲0.009	▲0.096
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.019	▲0.010	▲0.015	▲0.103
2W	▲0.028	▲0.008	▲0.017	▲0.107
3W	-	-	-	▲0.111
1M	▲0.013	▲0.008	▲0.011	▲0.115
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.005	▲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16日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	4月国内企業物価指数 [前年比]	+9.4%	21:30	(米)5月ニューヨーク連銀製造業景気指数	15.0
	-	-	18:00	(欧)3月貿易収支	-
	-	-		-	-

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▲0.002%の出合から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.002%の水準で取引された。積み最終日の着地を見据えたビッドサイドの調達意欲は強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.005%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.006 ~ ▲0.003	▲0.003 ~ ▲0.003	▲0.005 ~ ▲0.001

翌営業日のマーケット

新積み期初日でビッドサイドが調達に慎重な動きを見せ、出合いの水準は本日比で低下を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	5月13日	5月16日	5月13日	5月16日	5月17日
券	+1,900	+1,400	+1,400	+1,400	+2,000
財政	▲8,200	▲12,300	▲12,300	▲12,300	▲2,000
過不足	▲6,300	▲10,900	▲10,900	▲10,900	+0
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				+14,600	
CP等買入	▲500		▲900		+4,000
被災地金融機関支援					▲100
国債補充供給	+4,100	▲4,000	+4,000		
当座預金増減		▲6,700		+6,800	+3,900
当座預金残高		5,541,100		5,547,900	5,551,800
準備預金残高		4,881,200			
積み終了先		4,881,200	国庫短期証券発行・償還 (3M)		国債発行 (物連)
超過準備		4,881,200			
非準備先残高		659,900			
準備預金進捗率		100.0%			
平均		100.0%			
乖離率		0.0%			

5月13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)(5/16~)						
5~10年	0	0				
国債買入(5/16~)						
1~3年	4,750	12,138	4,757	▲0.004	▲0.003	37.7
3~5年	4,750	9,690	4,751	▲0.008	▲0.007	100.0
5~10年	5,000	16,292	5,014	▲0.008	▲0.007	18.1
国債補充供給(5/13~5/16)						
	3,962	3,962	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース (億円)
 5月12日時点 6,799,200

所要	(億円)
来積期の所要準備額	3,873,000
5月16日以降の残り所要	
積数	3,873,000
平均	124,900

国庫短期証券入札予定

5月19日	1年 (第1080回)
5月20日	3ヶ月(第1081回)
5月24日	6ヶ月
5月27日	3ヶ月
5月16日	物価連動
5月18日	5年
5月20日	20年
5月26日	40年

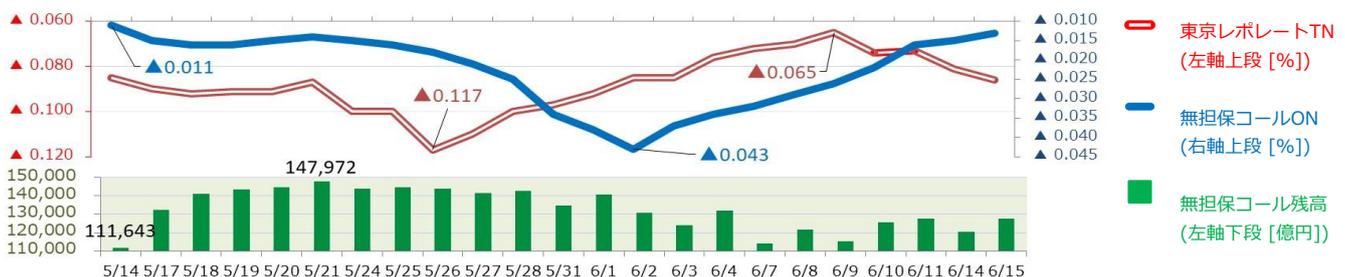
今月の国債買入オペ予定

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13日	2
3年超5年以下	4750	4,750	9 13 25 30	5月13日	2
5年超10年以下	5000	5,000	13 19 25 30	5月13日	3
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5月積み期 [5月14日~6月15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