



短期市場の推移

	5月11日	5月12日	5月13日	5月16日
加重平均金利	▲0.009	▲0.007	▲0.005	▲0.019
東京レポレート(TN)	▲0.098	▲0.098	▲0.096	▲0.102
無コール残	138,069	141,164	130,047	168,687
ON	70,496	73,341	63,234	97,899
その他	67,573	67,823	66,813	70,788
有コール残	29,843	30,747	30,075	29,754

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	▲0.060	0.001	▲0.018	▲0.104
T/N	-	-	▲0.010	▲0.146
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.012	▲0.131
2W	▲0.020	▲0.003	▲0.015	▲0.127
3W	-	-	-	▲0.126
1M	▲0.035	0.001	▲0.017	▲0.125
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.121
6M	-	-	-	▲0.114
1Y	-	-	-	▲0.112

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18日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	1-3月期国内総生産(GDP)速報値[前期比年率]	▲1.8%	ユーロ圏		
	3月の鉱工業生産確報(経産省)		4月の消費者物価(確報)		
			G7財務相、中銀総会議(20日まで)		

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▲0.018%の合出から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.015%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若干強くなり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.018%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.038	▲0.018 ~ ▲0.015	▲0.018 ~ ▲0.008

翌営業日のマーケット

大きな動向変化はなく、出合の水準は本日対比横ばい圏を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月17日		5月18日		5月19日	
券	+1,100		+300		+0	
財政	▲4,300		▲1,300		▲26,000	
過不足	▲3,200		▲1,000		▲26,000	
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	▲300	+4,000	▲300			
被災地金融機関支援	▲100					
国債補充供給	+6,100	▲5,700	+5,700			
当座預金増減	+800		+9,400		▲26,000	
当座預金残高	5,544,000		5,553,400		5,527,400	
準備預金残高	4,863,700		主な需給要因			
積み終了先	4,848,000		国債発行(5年)			
超過準備	4,503,100					
非準備先残高	680,300					
準備預金進捗率	99.3%					
平均	6.5%					
乖離率	92.8%					

5月17日のオペ結果

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国庫短期証券買入(5/18~)	5,000	21,006	5,000	0.005	0.007
国債買入(固定利回り方式)(5/18~)					
5~10年	0	0			
米ドル資金供給(5/19~5/26)	0	0	1.080	1.080	
国債補充供給(5/17~5/18)	5,718	5,718	▲0.350	▲0.370	
	0	0			

マネタリーベース (億円)
5月16日時点 6,791,300

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,873,000
5月18日以降の残り所要	
積数	27,400
平均	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(第1082回)
5月27日	3ヶ月

国債入札予定

5月18日	5年
5月20日	20年
5月26日	40年
5月31日	2年

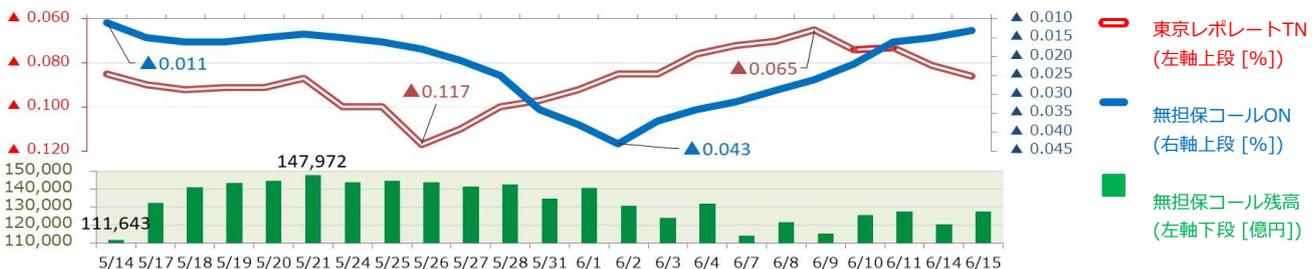
今月の国債買入オペ予定

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