



短期市場の推移

	4月27日	4月28日	5月1日	5月2日
加重平均金利	▲0.049	▲0.073	▲0.073	▲0.074
東京レボレート(TN)	▲0.210	▲0.153	▲0.174	▲0.153
無コール残	176,805	177,458	165,864	166,861
ON	95,102	101,020	88,526	93,513
その他	81,703	76,438	77,338	73,348
有コール残	25,236	23,000	22,900	21,800

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	▲0.085	0.001	▲0.073	▲0.097
T/N	-	-	-	▲0.103
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	▲0.025	▲0.055	▲0.123
2W	▲0.075	0.001	▲0.051	▲0.132
3W	-	-	▲0.010	▲0.141
1M	▲0.035	▲0.020	▲0.028	▲0.150
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.004	▲0.157
6M	-	-	-	▲0.129
1Y	-	-	-	▲0.102

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9日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	NY連銀総裁、講演	-
-	-	-	-
-	-	-	-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.075%の出合から始まり、その後は主に▲0.078%~ ▲0.065%の水準で取引された。大型連休明けとなった本日も市場動向に大きな変化はなく、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.073%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.077 ~ ▲0.073	- ~ -	▲0.078 ~ ▲0.070

翌営業日のマーケット

オファービッド共に主だった動態変化は見られないため、出合い水準は本日対比横ばいを予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	5月8日	5月9日	5月9日	5月10日	5月10日
券	+2,500	+2,900	+2,900	+2,000	+2,000
財政	▲33,100	▲4,700	▲4,700	▲30,000	▲30,000
過不足	▲30,600	▲1,800	▲1,800	▲28,000	▲28,000
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				+12,800	
CP等買入	▲200	▲200	▲200		
国債補完供給	+31,600	▲41,000	+41,000		
共通担保(全店)					▲10,900
当座預金増減	▲40,200	+51,800	+51,800	▲38,900	▲38,900
当座預金残高	5,468,000	5,519,800	5,519,800	5,480,900	5,480,900
準備預金残高	4,775,200				
積み終了先	4,774,600				
超過準備	4,774,600				
非準備先残高	692,800				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	76.7%				
乖離率	23.2%				

5月8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)(5/9~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(5/9~)						
~1年	1,500	4,653	1,500	0.000	0.006	
1~3年	4,250	11,195	4,257	0.000	0.001	47.7
3~5年	5,000	13,505	5,006	0.001	0.001	83.4
10~25年	2,000	3,943	2,006	0.001	0.004	18.8
国債補完供給(5/8~5/9)						
	41,106	41,106	▲0.450	▲0.450		
	0	0				

マネタリーベース

5月2日時点 6,784,700

所要

今積期の所要準備額	3,846,600
5月9日以降の残り所要	
積数	1,600
平均	200

国庫短期証券入札予定

5月9日	6ヶ月(第1155回)
5月12日	3ヶ月(第1156回)
5月18日	1年
5月19日	3ヶ月
5月9日	10年
5月11日	30年
5月15日	5年
5月17日	20年

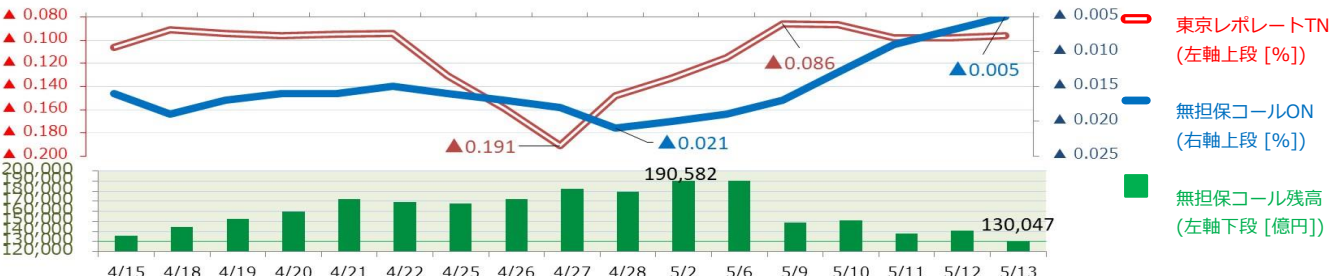
今月の国債買入オペ予定

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8日	0
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	8 12 18 24	5月8日	3
3年超5年以下	4,250~7,250	5,000	8 18 24 29	5月8日	3
5年超10年以下	4,750~8,750	6,750	12 18 24 29	4月27日	4
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	8 12 24 29	5月8日	3
25年超	500~3,500	1,000	12 18 29	4月27日	3
物価連動債	600	600	月1回	4月27日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	4月14日	0

1年前の市場推移

○2022年4月積み期 [4月15日~5月13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