



短期市場の推移

	4月28日	5月1日	5月2日	5月8日
加重平均金利	▲0.073	▲0.073	▲0.074	▲0.073
東京レボレート(TN)	▲0.153	▲0.174	▲0.153	▲0.103
無コール残	177,458	165,864	166,861	156,980
ON	101,020	88,526	93,513	88,407
その他	76,438	77,338	73,348	68,573
有コール残	23,000	22,900	21,800	26,928

【億円】 [%]

5月10日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)4月消費者物価コア指数	-
-	-	[前年比]	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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。

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

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	▲0.083	0.001	▲0.070	▲0.103
T/N	-	-	-	▲0.098
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	▲0.050	▲0.056	▲0.126
2W	-	-	-	▲0.136
3W	-	-	-	▲0.142
1M	-	-	▲0.003	▲0.151
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.155
6M	-	-	-	▲0.129
1Y	-	-	-	▲0.102

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.070%の出合から始まり、その後は主に▲0.075%～▲0.065%の水準で取引された。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.003%の▲0.070%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.076 ~ ▲0.073	- ~ -	▲0.075 ~ ▲0.065

翌営業日のマーケット

積み終盤を迎え取り手の調整ニーズの高まりから、出合い水準は本日対比若干の上昇を想定する。

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

資金需給

【億円】

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月9日	5月10日	5月10日	5月11日	5月11日	5月11日
券	+2,800	+2,500	+2,500	+2,000	+2,000	+2,000
財政	▲5,600	▲35,200	▲35,200	▲1,000	▲1,000	▲1,000
過不足	▲2,800	▲32,700	▲32,700	+1,000	+1,000	+1,000
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
国債買入		+12,800				
共通担保(全店)			▲10,900	+7,900		
CP等買入	▲200		▲100			
国債補充供給	+41,000	▲35,200	+35,200			
当座預金増減		+15,600	▲600	+1,000		
当座預金残高		5,483,600	5,483,000	5,484,000		
準備預金残高		4,798,500			主な需給要因	
積み終了先		4,798,100	国庫短期証券発行・償還(6M)			
超過準備		4,798,000	国債発行(10年)			
非準備預金先高		685,100				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		80.0%				
乖離率		19.9%				

5月9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
国債買入(固定利回り方式)(5/10~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(5/11~5/18)						
	0	0	5,320	5,320		
国債補充供給(5/9~5/10)						
	35,174	35,174	▲0.350	▲0.351		
	21	21	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(5/10~5/24)						
	7945	7945				

マナタリーベース 【億円】
5月8日時点 6,741,900

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,872,100
5月10日以降の残り所要	
積数	1,200
平均	200

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

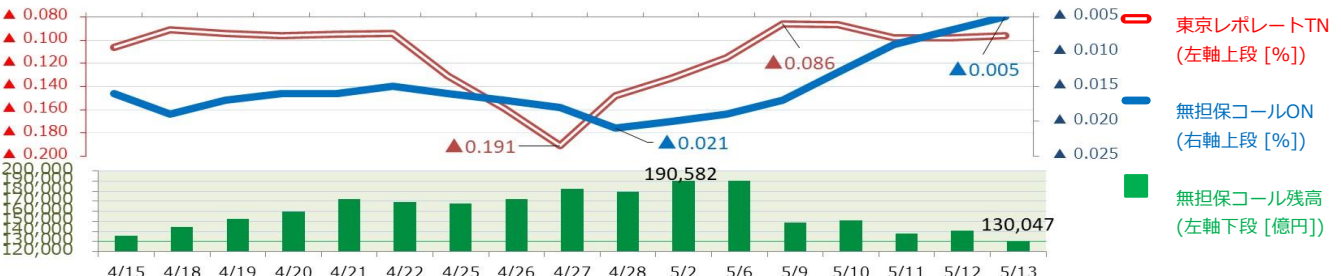
5月12日	3ヶ月(第1156回)
5月18日	1年
5月19日	3ヶ月
5月26日	3ヶ月
5月11日	30年
5月15日	5年
5月17日	20年
5月23日	物価連動

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。