



短期市場の推移

	5月2日	5月8日	5月9日	5月10日
加重平均金利	▲0.074	▲0.073	▲0.070	▲0.061
東京レポレート(TN)	▲0.153	▲0.103	▲0.098	▲0.098
無コール残	166,861	156,980	154,773	162,548
ON	93,513	88,407	85,300	93,565
その他	73,348	68,573	69,473	68,983
有コール残	21,800	26,928	24,653	26,949

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	▲0.070	0.001	▲0.046	▲0.097
T/N	-	-	-	▲0.100
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.048	▲0.035	▲0.038	▲0.124
2W	▲0.035	0.040	▲0.017	▲0.136
3W	-	-	-	▲0.142
1M	-	-	0.100	▲0.150
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.154
6M	-	-	-	▲0.129
1Y	-	-	-	▲0.102

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12日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	23:00 (米)5月ミシガン大学消費者信頼感指数速報	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.050%の出合から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.045%の水準で取引された。昨日同様にビッドサイドの調達ニーズが強く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.015%の▲0.046%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.045	- ~ -	▲0.050 ~ ▲0.040

翌営業日のマーケット

本日同様にビッドサイドの調達意欲は強く、出合い水準は本日対比上昇を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月11日	5月12日	5月11日	5月12日	5月11日	5月12日
券	+1,100		+1,600		+2,000	
財政	▲3,000		▲17,900		▲5,000	
過不足	▲1,900		▲16,300		▲3,000	
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				+1,000		
CP等買入	▲100		▲100			
被災地金融機関支援			▲900	+200		
国債補完供給	+30,000	▲28,700	+28,700			
当座預金増減	▲700		+12,600		▲3,000	
当座預金残高	5,452,700		5,465,300		5,462,300	
準備預金残高	4,763,900					
積み終了先	4,763,500					
超過準備	4,763,500					
非準備先残高	688,800					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	86.7%					
乖離率	13.2%					

5月11日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(5/12~)	1,000	4,401	1,001	0.000	0.001	47.0
国債買入(固定利回り方式)(5/12~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
CP等買入(5/16~)	4,000	4,525	3,995	▲0.028	0.014	
国債補完供給(5/11~5/12)	28,606	28,606	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
5月10日時点 6,722,000

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,872,100
5月12日以降の残り所要	
積数	300
平均	100

国庫短期証券入札予定

5月12日	3ヶ月(第1156回)
5月18日	1年(第1157回)
5月19日	3ヶ月
5月26日	3ヶ月

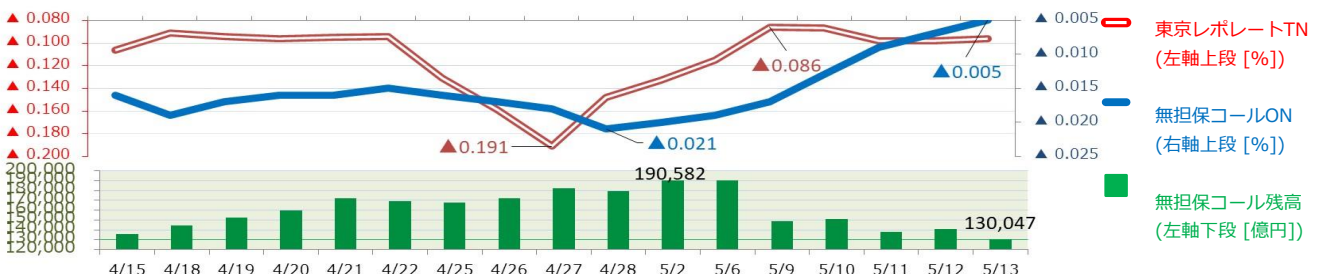
今日の国債買入オペ予定

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