



短期市場の推移

	5月8日	5月9日	5月10日	5月11日
加重平均金利	▲0.073	▲0.070	▲0.061	▲0.046
東京レボレート(TN)	▲0.103	▲0.098	▲0.098	▲0.100
無コール残	156,980	154,773	162,548	160,069
ON	88,407	85,300	93,565	89,736
その他	68,573	69,473	68,983	70,333
有コール残	26,928	24,653	26,949	26,597

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	▲0.060	0.001	▲0.030	▲0.091
T/N	-	-	-	▲0.095
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.035	▲0.123
2W	▲0.034	▲0.018	▲0.026	▲0.135
3W	-	-	-	▲0.142
1M	-	-	▲0.013	▲0.149
2M	-	-	0.030	-
3M	-	-	-	▲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15日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-			-	
	-			-	
	-			-	

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▲0.030%の合出から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.025%の水準で取引された。週末3日積みのため積極的に資金調達に動く先もあり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.016%の▲0.030%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.030	- ~ -	▲0.030 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

積み期最終日となるために調達量を抑える先もあり、出合水準はやや低下すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月12日	5月15日	5月15日	5月16日	5月16日	5月16日
券		+1,700		+1,500		+1,000
財政		▲19,600		▲2,500		▲25,000
過不足		▲17,900		▲1,000		▲24,000
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				
国債買入				+13,700		
CP等買入						+4,000
被災地金融機関支援	▲100		▲400			
国債補充供給	▲900	+200				
	+28,700	▲24,400	+24,400			
当座預金増減		▲13,400		+36,700		▲20,000
当座預金残高		5,439,300		5,476,000		5,456,000
準備預金残高		4,770,900				
積み終了先		4,770,800				
超過準備		4,770,800				
非準備先残高		668,400				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		96.7%				
乖離率		3.3%				

5月12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)(5/15~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(5/15~)						
1~3年	4,250	7,183	4,251	▲0.008	▲0.004	58.1
5~10年	6,250	13,550	6,265	▲0.014	▲0.012	62.8
10~25年	2,000	4,138	2,005	▲0.009	▲0.007	85.7
25年~	1,000	3,444	1,002	▲0.003	▲0.002	64.9
国債補充供給(5/12~5/15)						
24,396	24,396	▲0.350	▲0.351			
0	0					

マナターベース	所要
5月11日時点	6,720,100
今積期の所要準備額	3,872,100
5月15日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

5月18日	1年(第1157回)
5月19日	3ヶ月(第1158回)
5月26日	3ヶ月
6月2日	3ヶ月

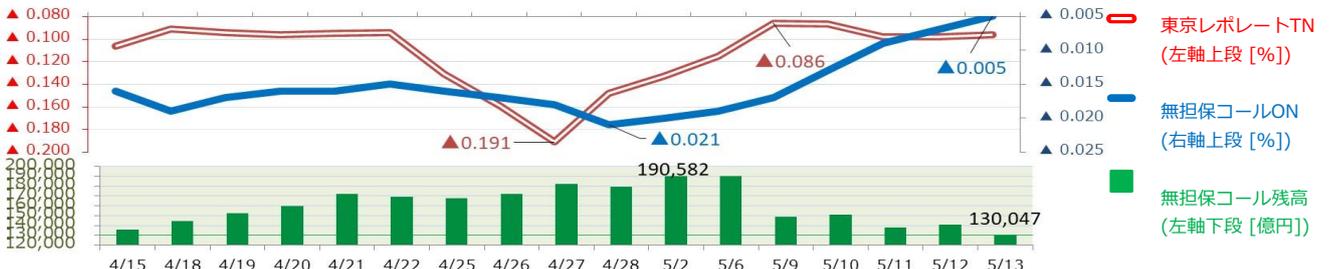
今月の国債買入オペ予定

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12日	2
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	6,250	12 18 24 29	5月12日	3
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	8 12 24 29	5月12日	2
25年超	500~3,500	1,000	12 18 29	5月12日	2
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