



短期市場の推移

	5月9日	5月10日	5月11日	5月12日
加重平均金利	▲0.070	▲0.061	▲0.046	▲0.030
東京レポレート(TN)	▲0.098	▲0.098	▲0.100	▲0.095
無コール残	154,773	162,548	160,069	155,390
ON	85,300	93,565	89,736	87,127
その他	69,473	68,983	70,333	68,263
有コール残	24,653	26,949	26,597	27,248

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	▲0.050	0.001	▲0.023	▲0.091
T/N	-	-	-	▲0.099
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.020	▲0.045	▲0.123
2W	▲0.030	▲0.003	▲0.023	▲0.132
3W	-	-	-	▲0.142
1M	▲0.050	0.000	▲0.031	▲0.150
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.156
6M	-	-	-	▲0.130
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16日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) 4月小売売上高	+0.7%
-	-	(米) 4月鉱工業生産	-
-	-	-	-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.028%の割合から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.015%の水準で取引された。積み最終日の調整もあり取り手の調達意欲は旺盛で、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.007%の▲0.023%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.010	- ~ -	▲0.030 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

積み初日のため、取り手の様子見姿勢もあり出合水準は本日対比低下を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月15日	5月16日	5月16日	5月17日	5月17日	5月17日
券		+1,500		+1,500		+1,000
財政		+700		▲25,600		▲1,000
過不足		+2,200		▲24,100		+0
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		+13,700				
CP等買入	▲400		▲200	+4,000		
国債補完供給	+24,400	▲28,600	+28,600			
当座預金増減		+11,300		+8,300		+0
当座預金残高		5,450,600		5,458,900		5,458,900
準備預金残高		4,833,900	主な需給要因			
積み終了先		4,833,900	国債発行(5年)			
超過準備		4,833,900				
非準備先残高		616,700				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		100.0%				
乖離率		0.0%				

5月15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)(5/16~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(5/15~5/16)						
	28,587	28,587	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マナタリーベース (億円)
5月12日時点 6,705,100

所要	(億円)
来積期の所要準備額	4,008,700
5月16日以降の残り所要	
積数	4,008,700
平均	129,300

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

国債入札予定

5月17日	20年
5月23日	物価連動
5月25日	40年
5月30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5月積み期 [5月16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。

東京レポレートTN (左軸上段 [%])

無担保コールON (右軸上段 [%])

無担保コール残高 (左軸下段 [億円])

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