



	5月12日	5月15日	5月16日	5月17日
加重平均金利	▲0.030	▲0.023	▲0.034	▲0.033
東京レポレート(TN)	▲0.095	▲0.099	▲0.097	▲0.100
無コール残	155,390	145,485	155,183	155,264
ON	87,127	77,572	89,940	88,281
その他	68,263	67,913	65,243	66,983
有コール残	27,248	28,644	28,598	26,537

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	▲0.087	0.001	▲0.034	▲0.093
T/N	-	-	-	▲0.102
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.003	▲0.021	▲0.124
2W	-	-	▲0.035	▲0.136
3W	-	-	▲0.005	▲0.144
1M	▲0.030	0.080	▲0.011	▲0.151
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.157
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19日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	4月の全国消費者物価(総務省)	コア前年比 3.4%上昇	(米) NY連銀総裁の講演	
	G7サミット(広島市、21日まで)			

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.035%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。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▲0.034%となった。

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

翌営業日のマーケット

3日積みのため資金調達ニーズは強まり、出合水準は本日対比で上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月18日	5月19日	5月19日	5月20日	5月22日	5月23日
債券	+300		+700		+1,000	
財政	▲11,200		+4,900		▲6,000	
過不足	▲10,900		+5,600		▲5,000	
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				+16,000		
CP等買入	▲100		▲500			
社債等買入			▲500			
国債補完供給	+25,500	▲25,600	+25,600			
当座預金増減	▲11,100		+46,200		▲5,000	
当座預金残高	5,419,500		5,465,700		5,460,700	
準備預金残高	4,724,800					
積み終了先	4,707,400					
超過準備	4,692,700					
非準備先残高	694,700					
準備預金進捗率	98.7%					
平均	9.7%					
乖離率	89.0%					

5月18日のオペ結果 [%][徳円]※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)(5/19~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(5/19~)						
1~3年	4,250	7,104	4,251	0.003	0.005	63.3
3~5年	5,000	11,077	5,007	0.000	0.001	63.7
5~10年	5,750	14,080	5,757	0.011	0.013	31.4
25年~	1,000	4,107	1,002	0.023	0.023	96.0
社債等買入(5/23~)						
1,000	2,214	1,000	0.216	0.232	27.3	
国債補完供給(5/18~5/19)						
25,496	25,496	▲0.350	▲0.351			
0	0					

マナターリベース [徳円]	所要 [徳円]
5月17日時点 6,693,000	今積期の所要準備額 4,008,700
	5月19日以降の残り所要
	積数 52,400
	平均 1,900

国債短期証券入札予定

5月19日	3ヶ月(第1158回)
5月26日	3ヶ月
6月2日	3ヶ月
6月8日	6ヶ月

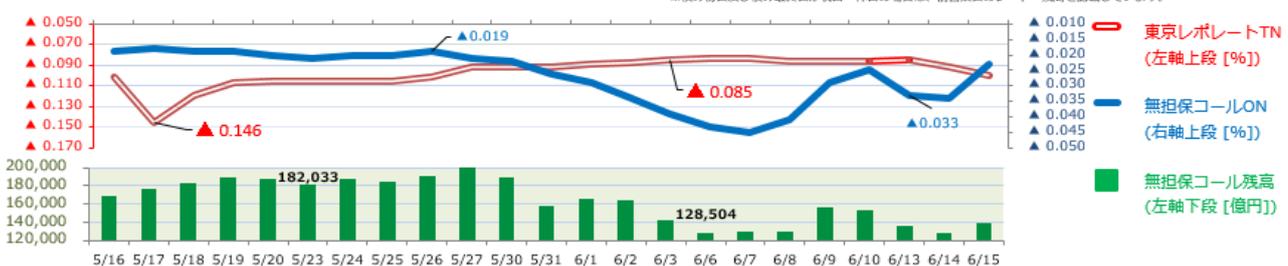
今月の国債買入オペ予定

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18日	1
3年超5年以下	4,250~7,250	5,000	8 18 24 29	5月18日	2
5年超10年以下	4,750~8,750	5,750	12 18 24 29	5月18日	2
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18日	1
物価運動債	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。



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した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