



短期市場の推移

	5月1日	5月2日	5月7日	5月8日
加重平均金利	0.077	0.077	0.077	0.077
東京レポレート(TN)	0.045	0.075	0.069	0.073
無コール残	80,673	83,170	77,640	88,159
ON	36,340	39,407	35,117	46,101
その他	44,333	43,763	42,523	42,058
有コール残	36,327	36,679	38,152	38,724

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	0.060	0.078	0.077	0.071
T/N	-	-	-	0.076
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.240	0.059
2W	0.160	0.195	0.185	0.051
3W	-	-	-	0.049
1M	0.110	0.230	0.185	0.050
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.056
6M	-	-	0.350	0.076
1Y	-	-	-	0.117

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10日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	国際収支 (3月)		-	
14:00	景気ウォッチャー調査 (4月)		-	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は0.078%の出合から始まり、その後は主に0.075%~0.078%を中心に取引された。ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.077%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	0.075 ~ 0.078

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であり、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月9日		5月10日		5月13日	
券	+2,100		+2,200		+2,000	
財政	▲32,900		▲4,700		▲15,000	
過不足	▲30,800		▲2,500		▲13,000	
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
CP等買入	▲500		▲400			
国債補充供給	+39,700	▲38,600	+38,600			
当座預金増減	▲30,200		+35,700		▲13,000	
当座預金残高	5,536,900		5,572,600		5,559,600	
準備預金残高	4,885,600		主な需給要因			
積み終了先	4,885,500		国庫短期証券発行償還 (6M)		国庫短期証券発行償還 (3M)	
超過準備	4,885,500		国債発行 (30年)			
非準備先残高	651,300					
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

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(5/9~5/10)	39,417	39,417	▲0.150	▲0.150		
	0	0				

マネタリーベース	5月8日時点	所要
	6,823,500	

今積期の所要準備額	3,961,600
5月10日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

国庫短期証券入札予定

5月10日	3ヶ月(第1230回)
5月16日	1年(第1231回)
5月17日	3ヶ月
5月24日	3ヶ月

国債入札予定

5月10日	30年
5月14日	5年
5月16日	20年
5月20日	物価連動

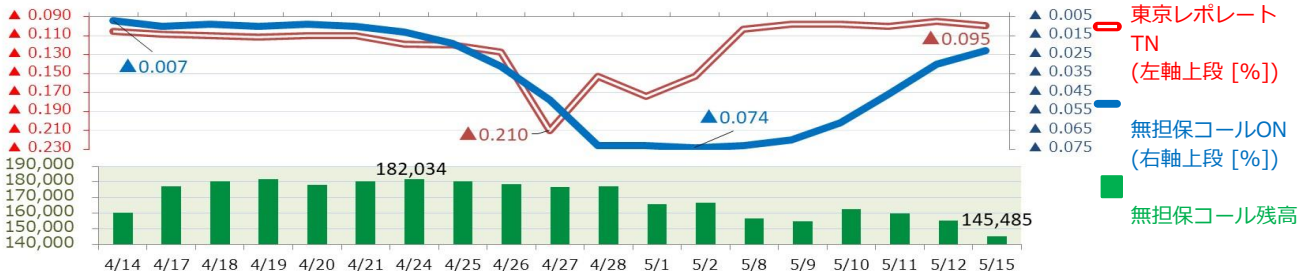
今月の国債買入オペ予定

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7日	0
1年超3年以下	3,000~4,500	3,750	7 13 17 23	5月7日	3
3年超5年以下	3,500~5,000	4,250	7 17 23 31	5月7日	3
5年超10年以下	4,000~5,500	4,750	13 17 23 31	4月24日	4
10年超25年以下	1,000~2,000	1,500	7 13 31	5月7日	2
25年超	500~1,000	750	17 31	4月24日	2
物価連動債	600	600	月1回	4月24日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

1年前の市場推移

○2023年4月積み期 [4月14日~5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