



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	0.477	0.477	0.477	0.476
東京レボレート(TN)	0.467	0.485	0.480	0.474
無コール残	94,839	89,289	83,931	84,981
ON	44,433	39,793	34,665	35,900
その他	50,406	49,496	49,266	49,081
有コール残	32,299	29,252	29,276	28,304

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	0.450	0.478	0.477	0.493
T/N	-	-	-	0.490
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.482	0.463
2W	-	-	0.530	0.460
3W	-	-	0.540	0.459
1M	-	-	0.620	0.458
2M	-	-	-	-
3M	0.575	0.700	0.606	0.467
6M	-	-	-	0.491
1Y	-	-	-	0.571

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12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)	(米) クーグラ-FRB理事の講演	

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の0.477%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477

翌営業日のマーケット

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12日	5月12日	5月13日	5月13日	5月13日
券	+1,900	+1,200	+1,200	+2,000	+2,000	+2,000
財政	▲30,100	▲6,600	▲6,600	▲3,000	▲3,000	▲3,000
過不足	▲28,200	▲5,400	▲5,400	▲1,000	▲1,000	▲1,000
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			▲100			
被災地金融機関支援			▲200			
国債補完供給	+5,100	▲4,000	+4,000			
当座預金増減	▲27,100	▲1,700	▲1,700	▲1,000	▲1,000	▲1,000
当座預金残高	5,341,900	5,340,200	5,340,200	5,339,200	5,339,200	5,339,200
準備預金残高	4,847,200	4,847,200	4,847,200	4,847,200	4,847,200	4,847,200
積み終了先	4,847,200	4,847,200	4,847,200	4,847,200	4,847,200	4,847,200
超過準備	4,847,200	4,847,200	4,847,200	4,847,200	4,847,200	4,847,200
非準備先残高	494,700	494,700	494,700	494,700	494,700	494,700
準備預金進捗率	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%
平均	86.7%	86.7%	86.7%	86.7%	86.7%	86.7%
乖離率	13.3%	13.3%	13.3%	13.3%	13.3%	13.3%

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
国債補完供給(5/9~5/12)	3,968	3,968	0.250	0.250		
	199	199	0.250	0.250		

マナタリーベース (億円)
 5月8日時点 6,599,100

所要	所要
今積期の所要準備額	3,983,000
5月12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16日	3ヶ月(第1306回)
5月19日	1年
5月23日	3ヶ月
5月30日	3ヶ月
5月13日	30年
5月15日	5年
5月20日	20年
5月22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	1000	1,000	7		0
1年超3年以下	2750	2,750	7 14 19 23	5月7日	3
3年超5年以下	2750	2,750	7 19 23 29	5月7日	3
5年超10年以下	3000	3,000	14 19 23 29	4月25日	4
10年超25年以下	1350	1,350	14 23 29	4月25日	3
25年超	750	750	7 19	5月7日	1
物価連動債	500	500	29	4月25日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

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