



短期市場の推移

[億円] [%]

	5月7日	5月8日	5月9日	5月12日
加重平均金利	0.477	0.476	0.477	0.477
東京レボレート(TN)	0.480	0.474	0.490	0.489
無コール残	83,931	84,981	82,934	83,302
ON	34,665	35,900	34,553	34,351
その他	49,266	49,081	48,381	48,951
有コール残	29,276	28,304	28,742	29,008

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	0.450	0.525	0.477	0.477
T/N	-	-	-	0.482
S/N	-	-	-	-
1W	0.482	0.550	0.496	0.466
2W	-	-	-	0.464
3W	-	-	-	0.460
1M	-	-	-	0.460
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.467
6M	-	-	-	0.492
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

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月13日	5月14日	5月13日	5月14日	5月13日	5月14日
券		+1,300		+1,200		+0
財政		▲10,500		▲10,900		▲6,000
過不足		▲9,200		▲9,700		▲6,000
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
共通担保(全店)		▲8,000		+8,000		
国債補充供給	+1,900	▲1,200	+1,200			
当座預金増減		▲8,500		▲8,500		▲6,000
当座預金残高		5,330,700		5,322,200		5,316,200
準備預金残高		4,826,500				
積み残了先		4,826,500				
超過準備		4,826,500				
非準備先残高		504,200				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		93.3%				
乖離率		6.7%				

5月13日のオペ結果

オペ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

米ドル資金供給(5/15~5/22)

0 0 4.580 4.580

国債補充供給(5/13~5/14)

1,199 1,199 0.250 0.250

7 7 0.250 0.250

共通担保(全店)(5/14~5/28)

8,000 14,096 8,005 56.8

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

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)は前営業日対比横ばいの0.477%となった。

都銀・信託

- ~ -

証券

0.477 ~ 0.477

地銀

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。

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(第1307回)
5月23日	3ヶ月
5月30日	3ヶ月

国債入札予定

5月15日	5年
5月20日	20年
5月22日	物価連動
5月28日	40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	1000	1,000	7	14	19	23	5月7日	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	14	19	23	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