



短期市場の推移

	4月30日	5月1日	5月7日	5月8日
加重平均金利	0.727	0.727	0.727	0.727
東京レポレート(TN)	0.751	0.753	0.754	0.755
無コール残	80,475	80,939	91,058	80,841
ON	28,562	28,710	38,659	27,342
その他	51,913	52,229	52,399	53,499
有コール残	22,982	23,893	23,916	24,622

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、無担保コール残高は無担保コール残高の値。
 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	0.700	0.728	0.726	0.745
T/N	-	-	-	0.754
S/N	-	-	-	-
1W	0.775	0.795	0.783	0.750
2W	-	-	-	0.750
3W	-	-	-	0.750
1M	-	-	-	0.750
2M	-	-	-	-
3M	-	-	1.000	0.857
6M	-	-	-	0.943
1Y	-	-	-	1.091

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12日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	金融政策決定会合における 主な意見 (4月27~28日分)		(米) 消費者物価 (4月)	
14:00	景気動向指数 (3月)		-	
15:00	コール市場残高 (4月)		-	

本日の市況

無担保コールON物は0.727%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)は前営業対比▲0.001%の0.726%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	- ~ -	0.727 ~ 0.727	0.727 ~ 0.727

翌営業日のマーケット

出合いの水準は本日対比横ばい圏を予想する。

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月11日	5月12日	5月12日	5月13日	5月13日	5月13日
券	+2,000	+2,100	+2,100	+1,500	+1,500	
財政	▲7,500	▲1,100	▲1,100	▲29,500	▲29,500	
過不足	▲5,500	+1,000	+1,000	▲28,000	▲28,000	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	スタート	
国債買入			+6,600			
共通担保(全店)					▲8,000	
国債補完供給	+1,400	▲3,100	+3,100			
当座預金増減	▲7,200	+10,700	+10,700	▲36,000	▲36,000	
当座預金残高	4,536,300	4,547,000	4,547,000	4,511,000	4,511,000	
準備預金残高	4,206,500	主な需給要因				
積み終了先	4,206,500	国債発行 (10年)				
超過準備	4,206,500	源泉税揚げ				
非準備先残高	329,800					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	86.7%					
乖離率	13.3%					

5月11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(5/12~)						
~1年	1,000	3,309	1,003	0.010	0.022	16.1
1~3年	2,550	6,770	2,555	0.006	0.007	80.2
3~5年	2,300	6,681	2,303	0.012	0.014	32.6
10~25年	800	2,522	802	0.045	0.051	100.0
25年~	750	2,181	751	0.041	0.048	6.7
国債補完供給(5/11~5/12)						
	3,416	3,416	0.550	0.550		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
5月8日時点 5,754,000

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,070,400
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15日	3ヶ月(第1381回)
5月19日	1年
5月22日	3ヶ月
5月29日	3ヶ月
国債入札予定	
5月12日	10年
5月14日	30年
5月18日	5年
5月20日	20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	11		5月11日 0
1年超3年以下	2550	2,550	11 15 21		5月11日 2
3年超5年以下	2300	2,300	11 21 28		5月11日 2
5年超10年以下	2400	2,400	15 21 28		4月23日 3
10年超25年以下	800	800	11 15 28		5月11日 2
25年超	750	750	11 21		5月11日 1
物価連動債	400	400	28		4月23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