



短期市場の推移

	[億円] [%]			
	5月1日	5月7日	5月8日	5月11日
加重平均金利	0.727	0.727	0.727	0.726
東京レボレート(TN)	0.753	0.754	0.755	0.754
無コール残	80,939	91,058	80,841	85,484
ON	28,710	38,659	27,342	30,675
その他	52,229	52,399	53,499	54,809
有コール残	23,893	23,916	24,622	25,425

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。無担保コール残高は無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	0.700	0.775	0.727	0.749
T/N	-	-	-	0.754
S/N	-	-	-	-
1W	0.731	0.783	0.764	0.750
2W	-	-	0.900	0.750
3W	-	-	-	0.750
1M	-	-	-	0.750
2M	-	-	-	-
3M	-	-	1.025	0.866
6M	-	-	-	0.946
1Y	-	-	-	1.092

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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	5月12日		5月13日		5月14日
券	+2,100		+1,300		+1,000
財政	▲5,500		▲22,100		+5,000
過不足	▲3,400		▲20,800		+6,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入	+6,600				
共通担保(全店)			▲8,000		+8,000
国債補完供給	+3,100	▲1,900	+1,900		
当座預金増減	+4,400		▲18,900		+6,000
当座預金残高	4,540,700		4,521,800		4,527,800
準備預金残高	4,203,300				
積み終了先	4,203,300		国債発行(10年)		
超過準備	4,203,300		源泉税揚げ		
非準備預金残高	337,400				
準備預金進捗率	100.0%				
平均	90.0%				
乖離率	10.0%				

[億円]

5月12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(5/12~5/13)	2,112	2,112	0.550	0.550		
共通担保(全店)(5/13~5/27)	8,000	18,469	8,009		43.4	

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

マナタリーベース [億円]
5月11日時点 5,744,800

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,070,400
5月13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(第1382回)
5月22日	3ヶ月
5月29日	3ヶ月
国債入札予定	
5月14日	30年
5月18日	5年
5月20日	20年
5月25日	5年クライメート・トランザクション

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