



短期市場の推移

	5月10日	5月13日	5月14日	5月15日
加重平均金利	0.077	0.077	0.077	0.077
東京レポレート(TN)	0.094	0.079	0.080	0.076
無コール残	78,412	83,133	82,391	83,666
ON	37,439	42,115	41,523	43,128
その他	40,973	41,018	40,868	40,538
有コール残	37,646	36,910	37,431	38,036

[億円] [%]

5月17日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		(欧) CPI (確報・4月)	

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	0.070	0.078	0.077	0.044
T/N	-	-	-	0.043
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.058
2W	-	-	-	0.059
3W	-	-	-	0.057
1M	-	-	0.200	0.052
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.190	0.065
6M	-	-	-	0.095
1Y	-	-	-	0.151

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。本日は積み期初日であり、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 ~ 0.075	- ~ -	0.075 ~ 0.078

翌営業日のマーケット

週末3日積み要因により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。

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

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	5月16日	5月17日	5月17日	5月20日	5月20日
券	+1,000	+700	+700	+2,000	+2,000
財政	▲1,100	▲8,200	▲8,200	+2,000	+2,000
過不足	▲100	▲7,500	▲7,500	+4,000	+4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲200	▲500	+3,000		
国債補完供給	+30,400	▲33,100	+33,100		
当座預金増減	▲3,000	+28,100	+28,100	+4,000	+4,000
当座預金残高	5,502,100	5,530,200	5,530,200	5,534,200	5,534,200
準備預金残高	4,845,600	主な需給要因			
積み終了先	3,561,800	国債発行(20年)	国庫短期証券発行償還		
超過準備	1,361,300		(3M・1Y)		
非準備先残高	656,500				
準備預金進捗率	85.4%				
平均	3.2%				
乖離率	82.2%				

5月16日のオペ結果

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(5/16~5/17)	33,950	33,950	▲0.150	▲0.150		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
5月15日時点 6,752,800

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,079,800
5月17日以降の残り所要	
積数	595,500
平均	19,900

国庫短期証券入札予定

5月17日	3ヶ月(第1232回)
5月24日	3ヶ月
5月31日	3ヶ月
6月6日	6ヶ月
5月20日	物価連動
5月22日	40年
5月28日	10年クライマート・トランジション
5月30日	2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	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13日	2
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	4,250	13 17 23 31	5月13日	3
10年超25年以下	1,000~2,000	1,500	7 13 31	5月13日	1
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	-

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