



短期市場の推移

	5月13日	5月14日	5月15日	5月16日
加重平均金利	0.077	0.077	0.077	0.077
東京レポレート(TN)	0.079	0.080	0.076	0.043
無コール残	83,133	82,391	83,666	72,570
ON	42,115	41,523	43,128	31,832
その他	41,018	40,868	40,538	40,738
有コール残	36,910	37,431	38,036	37,940

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	0.075
T/N	-	-	-	0.081
S/N	-	-	-	-
1W	0.119	0.240	0.130	0.063
2W	-	-	-	0.060
3W	-	-	-	0.059
1M	0.160	0.215	0.167	0.057
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.072
6M	-	-	-	0.094
1Y	-	-	-	0.156

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20日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-			-	
	-			-	
	-			-	

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。ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であり、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 ~ 0.078

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、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17日	5月20日	5月20日	5月21日	5月21日	5月21日
券	+800		+400		+1,000	
財政	▲10,000		+1,500		▲3,000	
過不足	▲9,200		+1,900		▲2,000	
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
国債買入				+13,000		
CP等買入	▲500	+3,000	▲100			
国債補完供給	+33,100	▲30,500	+30,500			
当座預金増減	▲4,100		+45,300		▲2,000	
当座預金残高	5,498,000		5,543,300		5,541,300	
準備預金残高	4,847,300		主な需給要因			
積み終了先	4,839,600		国庫短期証券発行償還	国債発行(物連10年)		
超過準備	4,657,400		(3M・1Y)			
非準備先残高	650,700					
準備預金進捗率	99.4%					
平均	12.9%					
乖離率	86.5%					

5月17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(5/20~)						
1~3年	3,750	7,440	3,751	0.003	0.006	1.5
3~5年	4,250	7,691	4,254	0.006	0.008	84.2
5~10年	4,250	11,634	4,257	0.008	0.009	70.2
25年~	750	2,359	753	0.028	0.031	64.8
国債補完供給(5/17~5/20)						
	31,210	31,210	▲0.250	▲0.250		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
5月16日時点 6,748,900

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,079,800
5月20日以降の残り所要	
積数	24,800
平均	900

国庫短期証券入札予定

5月24日	3ヶ月(第1233回)
5月31日	3ヶ月
6月6日	6ヶ月
6月7日	3ヶ月

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17日	1
3年超5年以下	3,500~5,000	4,250	7 17 23 31	5月17日	2
5年超10年以下	4,000~5,500	4,250	13 17 23 31	5月17日	2
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	5月17日	1
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	-

国債入札予定

5月20日	物価連動
5月22日	40年
5月28日	10年クライメート・トランジション
5月30日	2年

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