



短期市場の推移

	5月23日	5月24日	5月25日	5月26日
加重平均金利	▲0.021	▲0.020	▲0.020	▲0.019
東京レボレート(TN)	▲0.106	▲0.105	▲0.106	▲0.101
無コール残	182,033	188,198	184,397	191,276
ON	103,060	100,245	91,879	97,858
その他	78,973	87,953	92,518	93,418
有コール残	30,693	30,078	30,309	30,158

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

本日の市況

5月30日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-		(米) 休場	
-		(欧) 臨時首脳会議	
-		-	

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

	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	▲0.060	0.001	▲0.021	▲0.088
T/N	▲0.018	▲0.012	▲0.015	▲0.092
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	-	-	▲0.015	▲0.100
2W	-	-	0.001	▲0.103
3W	-	-	-	▲0.109
1M	▲0.008	0.200	0.022	▲0.117
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.016	▲0.117
6M	-	-	-	▲0.114
1Y	-	-	-	▲0.114

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

本日の無担保コールON物は▲0.020%の割合から始まり、その後は主に▲0.028%～▲0.015%の水準で取引された。週末3日積みではあったが、オファー・ビッドともに市場動向に大きな変化はみられず、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002の▲0.021%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.020 ~ ▲0.010	▲0.030 ~ ▲0.008

登営業日のマーケット

オファー・ビッド動向に特段の変化はなく、出合水準は本日対比横ばい圏と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月27日		5月30日		5月31日	
券	▲100		+400		▲900	
財政	▲7,700		▲19,800		+7,200	
過不足	▲7,800		▲19,400		+6,300	
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
国庫短期証券買入	+5,000					
CP等買入	▲200		▲400			
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+3,300		+1,400			
新型コロナ対応金融支援特別	▲69,200		+3,000			
当座預金増減	▲67,300		▲18,500		+10,300	
当座預金残高	5,500,000		5,481,500		5,491,800	
準備預金残高	4,821,800					
積み終了先	4,821,400					
超過準備	4,821,400					
非準備先残高	678,200					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	45.2%					
乖離率	54.7%					

5月27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
国債買入(固定利回り方式)(5/30~)						
5~10年	0	0				
国債補完供給(5/27~5/30)						
	1,395	1,395	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

5月26日時点 6,814,500

所要

今積期の所要準備額 3,873,000

5月30日以降の残り所要

積数 1,300

平均 100

国庫短期証券入札予定

6月3日	3ヶ月(第1084回)
6月9日	6ヶ月
6月10日	3ヶ月
6月14日	6ヶ月

国債入札予定

5月31日	2年
6月2日	10年
6月7日	30年
6月21日	5年

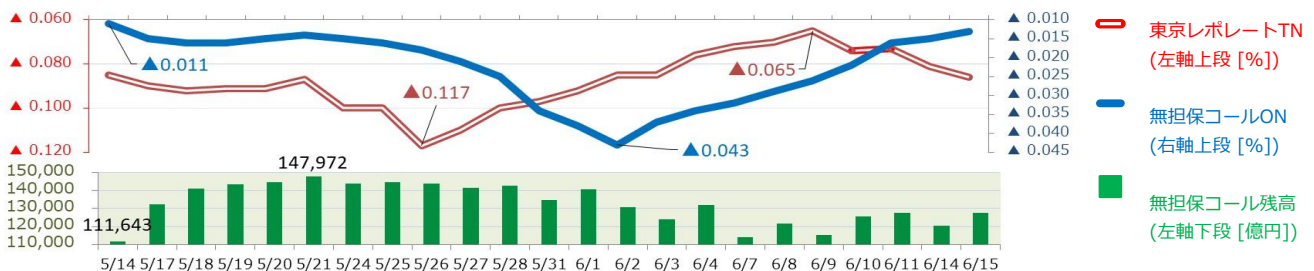
今月の国債買入オペ予定

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9日	0
1年超3年以下	4750	4,750	9 13 19 25	5月25日	0
3年超5年以下	4750	4,750	9 13 25 30	5月25日	1
5年超10年以下	5000	5,000	13 19 25 30	5月25日	1
10年超25年以下	1250	1,250	9 25	5月25日	0
25年超	500	500	19 30	5月19日	1
物価連動債	600	600	月1回	4月26日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	4月8日	0

1年前の市場推移

○2021年5月積み期 [5月14日~6月15日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



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