



デイリーシグナル

2022年5月31日(火)

短期市場の推移

	5月25日	5月26日	5月27日	5月30日
加重平均金利	▲0.020	▲0.019	▲0.021	▲0.022
東京レポレート(TN)	▲0.106	▲0.101	▲0.092	▲0.092
無コール残	184,397	191,276	208,619	189,356
ON	91,879	97,858	116,926	99,063
その他	92,518	93,418	91,693	90,293
有コール残	30,309	30,158	30,798	31,186

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	▲0.060	0.001	▲0.026	▲0.096
T/N	-	-	▲0.013	▲0.092
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.100
2W	-	-	▲0.020	▲0.104
3W	-	-	-	▲0.111
1M	-	-	-	▲0.117
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.115
6M	-	-	-	▲0.112
1Y	-	-	-	▲0.111

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

6月1日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	23:00 (米)5月ISM製造業景況指数	-
-	-	-	-
-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.015%の合出から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.015%の水準で取引された。月末につき資金調達を控える先が一部見られたことで、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.004%の▲0.026%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.030 ~ ▲0.020	▲0.030 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

資金調達を控えていた先が戻ってくることで、出合水準は本日対比若干の上昇を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月31日	6月1日	6月1日	6月2日	6月2日	6月2日
券	+700	+300	+300	+1,000	+1,000	+1,000
財政	▲2,600	▲54,800	▲54,800	+0	+0	+0
過不足	▲1,900	▲54,500	▲54,500	+1,000	+1,000	+1,000
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
国庫短期証券買入				+5,000		
国債買入		+11,000				
CP等買入	▲2,400	+4,000				
社債等買入	▲200					
国債補充供給	+2,500	▲2,200	+2,200			
当座預金増減	+10,800	▲47,300	▲47,300	+1,000	+1,000	+1,000
当座預金残高	5,487,900	5,440,600	5,440,600	5,441,600	5,441,600	5,441,600
準備預金残高	4,811,100	主な需給要因				
積み終了先	4,810,700	国債発行・償還(2Y)				
超過準備	4,810,700					
非準備先残高	676,800					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	51.6%					
乖離率	48.3%					

5月31日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(6/1~)	5,000	19,986	5,006	0.007	0.009	10.9
国債買入(固定利回り方式)(6/1~)	5~10年	0	0			
米ドル資金供給(6/2~6/9)		0	0	1.080	1.080	
国債補充供給(5/31~6/1)		2,116	2,116	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マナタリベース	所要
5月30日時点	6,723,900
今積期の所要準備額	3,873,000
6月1日以降の残り所要	
積数	500
平均	0

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

6月2日	10年
6月7日	30年
6月21日	5年
6月23日	20年

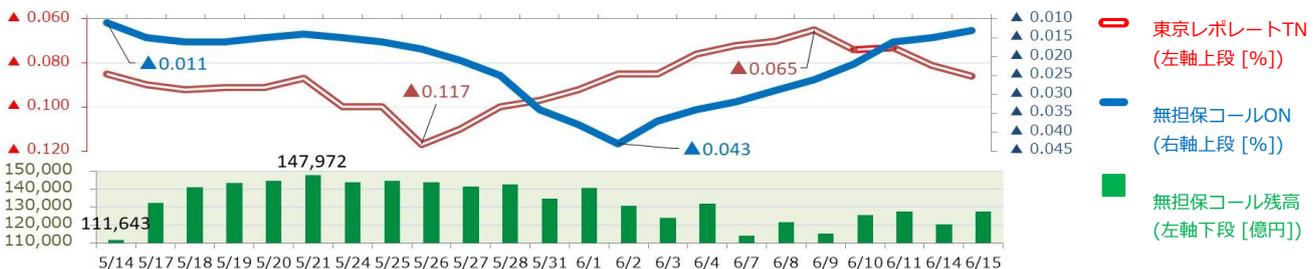
来月の国債買入オペ予定

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	1
1年超3年以下	4750	4,750	3 8 15 22	5月25日	4
3年超5年以下	4750	4,750	3 8 15 29	5月30日	4
5年超10年以下	5000	5,000	8 15 22 29	5月30日	4
10年超25年以下	1250	1,250	8 29	5月25日	2
25年超	500	500	3 22	5月30日	2
物価連動債	600	600	月1回	5月30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