



短期市場の推移

[億円] [%]

	5月15日	5月16日	5月17日	5月18日
加重平均金利	▲0.023	▲0.034	▲0.033	▲0.034
東京レボ レート(TN)	▲0.099	▲0.097	▲0.100	▲0.102
無コール残	145,485	155,183	155,264	154,278
ON	77,572	89,940	88,281	85,595
その他	67,913	65,243	66,983	68,683
有コール残	28,644	28,598	26,537	27,632

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

[%]

	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	▲0.087	0.001	▲0.031	▲0.096
T/N	-	-	-	▲0.107
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.020	▲0.124
2W	▲0.033	0.030	▲0.012	▲0.138
3W	-	-	▲0.005	▲0.145
1M	▲0.025	0.080	▲0.002	▲0.151
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.025	▲0.158
6M	-	-	-	▲0.130
1Y	-	-	-	▲0.102

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

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月19日	5月22日	5月22日	5月23日	5月23日	5月23日
券		+700	+700			+1,000
財政		+3,700	▲4,900			+2,000
過不足		+4,400	▲4,200			+3,000
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		+16,000				
CP等買入	▲500		▲400			
社債等買入	▲500					
国債補完供給	+25,600	▲26,100	+26,100			
当座預金増減		+18,900	+21,500			+3,000
当座預金残高		5,438,400	5,459,900			5,462,900
準備預金残高		4,728,300				
積み終了先		4,723,500				
超過準備		4,719,500				
非準備先残高		710,100				
準備預金進捗率		99.4%				
平均		19.4%				
乖離率		80.0%				

5月19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)(5/22~)

5~10年 0 0

5~10年 0 0

国債補完供給(5/19~5/22)

26,103 26,103 ▲0.350 ▲0.350

0 0

マネタリーベース [億円]

5月18日時点 6,681,600

所要

[億円]

今積期の所要準備額 4,008,700

5月22日以降の残り所要

積数 25,900

平均 1,000

国庫短期証券入札予定

5月26日	3ヶ月(第1159回)
6月2日	3ヶ月
6月8日	6ヶ月
6月9日	3ヶ月

国債入札予定

5月23日	物価連動
5月25日	40年
5月30日	2年
6月1日	10年

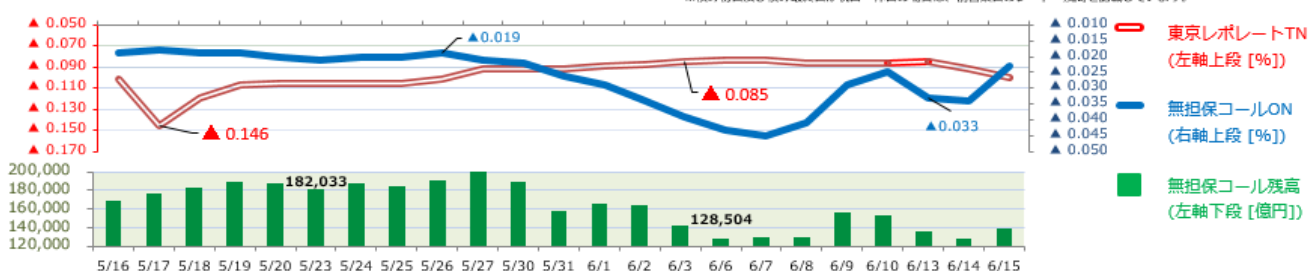
今月の国債買入オペ予定

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8日	0
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	8	12	18	24			5月18日	1
3年超5年以下	4,250~7,250	5,000	8	18	24	29			5月18日	2
5年超10年以下	4,750~8,750	5,750	12	18	24	29			5月18日	2
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	8	12	24	29			5月12日	2
25年超	500~3,500	1,000	12	18	29				5月18日	1
物価連動債	600	600	月1回						4月27日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回						4月14日	0

1年前の市場推移

○2022年5月積み期 [5月16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