



短期市場の推移

	5月16日	5月17日	5月18日	5月19日
加重平均金利	▲0.034	▲0.033	▲0.034	▲0.031
東京レポレート(TN)	▲0.097	▲0.100	▲0.102	▲0.107
無コール残	155,183	155,264	154,278	162,606
ON	89,940	88,281	85,595	92,973
その他	65,243	66,983	68,683	69,633
有コール残	28,598	26,537	27,632	27,949

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	▲0.087	0.001	▲0.034	▲0.104
T/N	-	-	-	▲0.121
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	▲0.020	▲0.041	▲0.134
2W	▲0.050	0.001	▲0.037	▲0.144
3W	-	-	-	▲0.150
1M	-	-	0.011	▲0.155
2M	-	-	0.030	-
3M	0.004	0.015	0.007	▲0.161
6M	-	-	-	▲0.133
1Y	-	-	-	▲0.102

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23日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-			-	
	-			-	
	-			-	

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.035%の出合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.035%の水準で取引された。週末3日積み必要因剥落のためビッドサイドの調達意欲が減退し、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.003%の▲0.034%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.035	- ~ -	▲0.040 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

オファービッド共に主だった動態変化は見られないため、出会い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22日	5月23日	5月23日	5月24日	5月24日	5月24日
券	+700	+600	+600	+1,000	+1,000	+1,000
財政	▲5,100	▲4,100	▲4,100	▲1,000	▲1,000	▲1,000
過不足	▲4,400	▲3,500	▲3,500	+0	+0	+0
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
共通担保(全店)					▲7,900	
CP等買入	▲400					
社債等買入			+1,000			
国債補完供給	+26,100	▲28,800	+28,800			
当座預金増減	▲7,500	+26,300	+26,300	▲7,900	▲7,900	▲7,900
当座預金残高	5,430,900	5,457,200	5,457,200	5,449,300	5,449,300	5,449,300
準備預金残高	4,733,500					
積み終了先	4,729,400					
超過準備	4,729,400					
非準備先残高	697,400					
準備預金進捗率	99.5%					
平均	22.6%					
乖離率	76.9%					

5月22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)(5/23~)						
5~10年	0	0	0			
5~10年	0	0	0			
国債補完供給(5/22~5/23)						
	28,854	28,854	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
5月19日時点 6,699,700

所要	今積期の所要準備額	4,008,700
5月23日以降の残り所要	積数	21,800
	平均	900

国債短期証券入札予定

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	物価運動
5月25日	40年
5月30日	2年
6月1日	10年

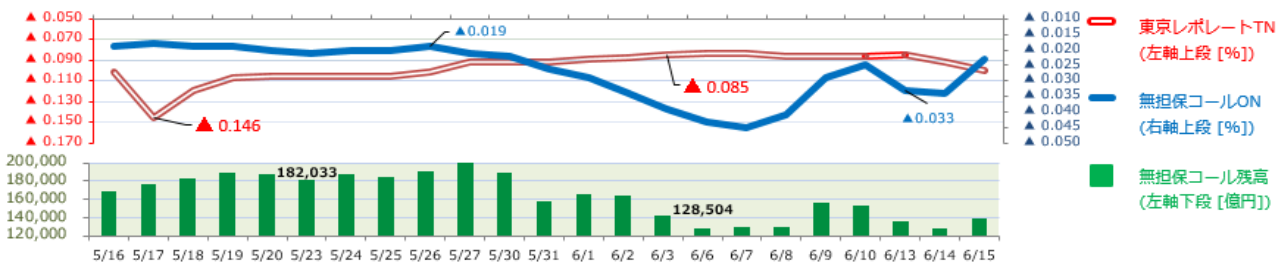
今月の国債買入オペ予定

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
物価運動債	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した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