



短期市場の推移

	5月17日	5月18日	5月19日	5月22日
加重平均金利	▲0.033	▲0.034	▲0.031	▲0.034
東京レポレート(TN)	▲0.100	▲0.102	▲0.107	▲0.121
無コール残	155,264	154,278	162,606	160,716
ON	88,281	85,595	92,973	89,663
その他	66,983	68,683	69,633	71,053
有コール残	26,537	27,632	27,949	25,855

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	▲0.037	▲0.107
T/N	-	-	-	▲0.128
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.035	▲0.140
2W	▲0.048	▲0.039	▲0.046	▲0.149
3W	-	-	-	▲0.154
1M	-	-	▲0.035	▲0.158
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.162
6M	-	-	-	▲0.134
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24日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) FOMC議事録 (5月2・3日分)	-
-	-	-	-
-	-	-	-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.035%の合出から始まり、その後は主に▲0.045%~▲0.035%の水準で取引された。昨日同様にビッドサイドの調達ニーズは限定的であり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.003%の▲0.037%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.045 ~ ▲0.040	- ~ -	▲0.045 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

オファービッド動向に大きな変化はなく、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23日		5月24日		5月25日	
券	+500		+100		+1,000	
財政	▲4,200		▲1,900		+14,500	
過不足	▲3,700		▲1,800		+15,500	
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				+1,000		
共通担保(全店)			▲7,900	+7,200		
CP等買入			▲400			
社債等買入		+1,000				
国債補充供給	+28,800	▲27,400	+27,400			
当座預金増減	▲1,300		+26,000		+15,500	
当座預金残高	5,429,600		5,455,600		5,471,100	
準備預金残高	4,730,300		主な需給要因			
積み終了先	4,726,500		物価連動債		各種財政資金の支払い	
超過準備	4,726,300		発行(10年)			
非準備先残高	699,300					
準備預金進捗率	99.6%					
平均	25.8%					
乖離率	73.8%					

5月23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(5/24~)	1,000	5,723	1,003	0.003	0.003	49.4
国債買入(固定利回り方式)(5/24~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(5/25~6/1)						
	0	0	5,330	5,330		
国債補充供給(5/23~5/24)						
	27,433	27,433	▲0.350	▲0.351		
	0	0				
共通担保(全店)(5/24~6/7)						
	7,715	7,715				

マネタリーベース (億円)
5月22日時点 6,691,500

所要	今積期の所要準備額
5月24日以降の残り所要	4,008,700
積数	17,700
平均	800

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25日	40年
5月30日	2年
6月1日	10年
6月6日	30年

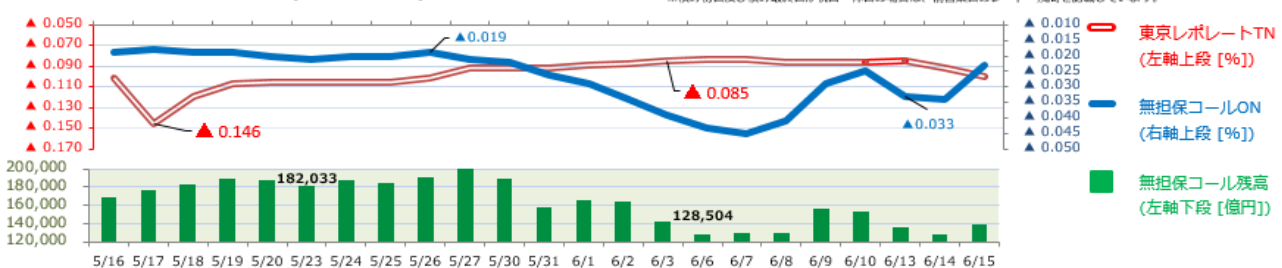
今月の国債買入オペ予定

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