



短期市場の推移

	5月22日	5月23日	5月24日	5月25日
加重平均金利	▲0.034	▲0.037	▲0.047	▲0.059
東京レボレート(TN)	▲0.121	▲0.128	▲0.210	▲0.257
無コール残	160,716	164,353	166,315	167,871
ON	89,663	93,260	93,822	92,138
その他	71,053	71,093	72,493	75,733
有コール残	25,855	26,878	25,858	24,097

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	▲0.063	▲0.108
T/N	-	-	-	▲0.144
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.161
2W	▲0.050	▲0.040	▲0.044	▲0.170
3W	-	-	▲0.037	▲0.171
1M	-	-	-	▲0.172
2M	-	-	0.020	-
3M	-	-	-	▲0.166
6M	-	-	-	▲0.136
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

5月29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▲0.060%の出合から始まり、その後は主に▲0.065%~▲0.058%の水準で取引された。ビットサイドの調達ニーズの減退は引き続き継続しており、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.004%の▲0.063%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.066 ~ ▲0.063	▲0.065 ~ ▲0.058

翌営業日のマーケット

オファーサイド、ビットサイド共に主だった動態変化は見られないため、出合の水準は本日対比横ばい圏を想定する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月26日	5月29日	5月29日	5月30日	5月30日	5月30日
券	▲100	+500	+500	+1,000	+1,000	+1,000
財政	+10,900	▲12,200	▲12,200	▲1,500	▲1,500	▲1,500
過不足	+10,800	▲11,700	▲11,700	▲500	▲500	▲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
CP等買入	▲200		▲300			
社債等買入			▲100			
国債補充供給	+29,100	▲26,800	+26,800			
新型コロナ対応金融支援特別	▲5,400					
当座預金増減	+7,500	+14,700	+14,700	▲500	▲500	▲500
当座預金残高	5,465,600	5,480,300	5,480,300	5,479,800	5,479,800	5,479,800
準備預金残高	4,775,200	4,774,400	4,774,400	4,774,400	4,774,400	4,774,400
積み終了先	4,774,400					
超過準備	4,773,500					
非準備先残高	690,400					
準備預金進捗率	99.8%					
平均	41.9%					
乖離率	57.9%					

5月26日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(固定利回り方式)(5/29~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
CP等買入(5/31~)						
	4,000	7,188	3,997	0.002	0.014	
国債補充供給(5/26~5/29)						
	26,797	26,797	▲0.550	▲0.550		
	0	0				

マナタリーベース (億円)
5月25日時点 6,718,300

所要	(億円)
今積期の所要準備額	4,008,700
5月29日以降の残り所要	
積数	7,200
平均	400

国庫短期証券入札予定

6月2日	3ヶ月(第1160回)
6月8日	6ヶ月
6月9日	3ヶ月
6月15日	3ヶ月
5月30日	2年
6月1日	10年
6月6日	30年
6月22日	5年

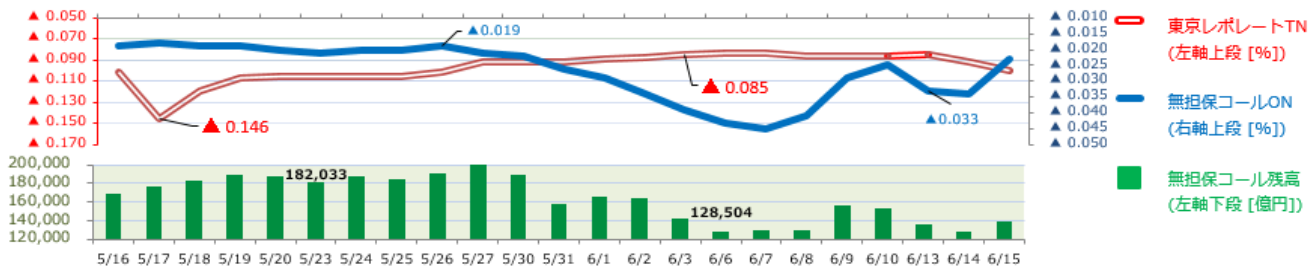
今月の国債買入オペ予定

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8日	0
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	8 12 18 24	5月24日	0
3年超5年以下	4,250~7,250	5,000	8 18 24 29	5月24日	1
5年超10年以下	4,750~8,750	5,750	12 18 24 29	5月24日	1
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	8 12 24 29	5月24日	1
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	-

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