



短期市場の推移

	5月24日	5月25日	5月26日	5月29日
加重平均金利	▲0.047	▲0.059	▲0.063	▲0.062
東京レボレート(TN)	▲0.210	▲0.257	▲0.144	▲0.151
無コール残	166,315	167,871	167,263	162,964
ON	93,822	92,138	92,380	87,391
その他	72,493	75,733	74,883	75,573
有コール残	25,858	24,097	25,929	23,413

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	▲0.064	▲0.147
T/N	-	-	-	▲0.163
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.068	▲0.060	▲0.065	▲0.167
2W	-	-	▲0.002	▲0.167
3W	-	-	-	▲0.167
1M	-	-	▲0.025	▲0.168
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.166
6M	-	-	-	▲0.134
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31日の予定 (時刻は日本時間)

日本			海外		
		予想			予想
8:50	鉱工業生産速報(4月)	前月比 1.3%増		(米) ペー.jupiterック	
				-	
				-	

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.065%の合出から始まり、その後は主に▲0.070%～▲0.065%の水準で取引された。市場動向に大きな変化はなく、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002の▲0.064%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.065	▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.065 ~ ▲0.065

翌営業日のマーケット

月末の取引を控えるビッドサイドの動きが想定され、出合いの水準は本日対比若干の低下を予想する。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	5月30日	5月31日	6月1日
券	+800	+700	▲1,000
財政	+7,000	▲1,900	▲18,000
過不足	+7,800	▲1,200	▲19,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		▲1,000	
国債買入	+14,700		
CP等買入	▲300	▲2,300	+4,000
国債補充供給	+37,400	+29,800	
当座預金増減	+29,800	+31,300	▲19,000
当座預金残高	5,473,100	5,504,400	5,485,400
準備預金残高	4,760,200	主な需給要因	
積み終了先	4,759,500	国債発行・償還(2年)	
超過準備	4,759,500		
非準備先残高	712,900		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	48.4%		
乖離率	51.5%		

5月30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

国庫短期証券買入(5/31~)

1,000 6,430 1,000 0.004 0.004 99.7

国債買入(固定利回り方式)(5/31~)

5~10年 0 0

5~10年 0 0

米ドル資金供給(6/1~6/8)

0 0 5.330 5.330

国債補充供給(5/30~5/31)

29,713 29,713 ▲0.450 ▲0.451

0 0

マネタリーベース [億円]

5月29日時点 6,703,100

所要

今積期の所要準備額 4,008,700

5月31日以降の残り所要

積数 5,600

平均 300

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

国債入札予定

6月1日	10年
6月6日	30年
6月22日	5年
6月27日	20年

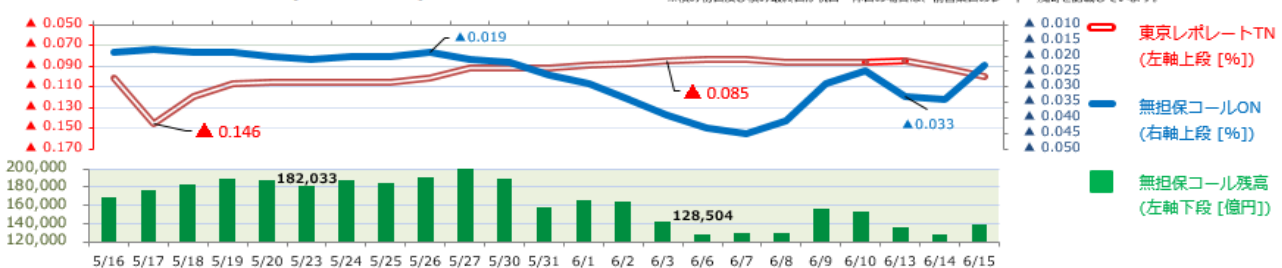
今月の国債買入オペ予定

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29日	0
5年超10年以下	4,750~8,750	5,750	12 18 24 29	5月29日	0
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	8 12 24 29	5月29日	0
25年超	500~3,500	1,000	12 18 29	5月29日	0
物価連動債	600	600	月1回	5月29日	0
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