



短期市場の推移

	5月26日	5月29日	5月30日	5月31日
加重平均金利	▲0.063	▲0.062	▲0.064	▲0.071
東京レポレート(TN)	▲0.144	▲0.151	▲0.163	▲0.126
無コール残	167,263	162,964	170,952	159,567
ON	92,380	87,391	94,899	91,524
その他	74,883	75,573	76,053	68,043
有コール残	25,929	23,413	23,644	24,158

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	▲0.070	▲0.119
T/N	-	-	▲0.075	▲0.141
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.076	▲0.003	▲0.057	▲0.152
2W	-	-	▲0.073	▲0.156
3W	-	-	-	▲0.157
1M	-	-	0.250	▲0.175
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.164
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

6月2日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30	(米) 5月雇用統計
-	-	-	-
-	-	-	-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.070%の合出から始まり、その後は主に▲0.080%~ ▲0.070%の水準で取引された。ビッドサイドの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+0.001%の▲0.070%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.070	▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.080 ~ ▲0.070

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達意欲の減退から、出合水準は低下を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月1日	6月2日	6月2日	6月5日	6月5日	6月5日
券	+100	+700		+0		+0
財政	▲61,400	▲55,200		▲1,000		▲1,000
過不足	▲61,300	▲54,500		▲1,000		▲1,000
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
社債等買入		▲800				
国債補充供給	+27,900	▲30,800	+30,800			
成長基盤強化支援			▲4,600			
当座預金増減	▲64,200	▲29,100	▲1,000			
当座預金残高	5,400,300	5,371,200	5,370,200			
準備預金残高	4,693,600	主な需給要因				
積み終了先	4,693,300	法人税、消費税、保				
超過準備	4,693,200	除揚げ				
非準備先残高	706,700	普通交付税 国債発				
準備預金進捗率	99.9%	行(10年)				
平均	54.8%					
乖離率	45.1%					

6月1日のオペ結果

オベ種類 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)(6/2~)	5~10年	0	0
5~10年	0	0	
5~10年	0	0	

国債補充供給(6/1~6/2)

30,804	30,804	▲0.350	▲0.350
0	0		

マネタリーベース (億円)
5月31日時点 6,722,800

所要	今積期の所要準備額	4,008,700
6月2日以降の残り所要	積数	4,300
	平均	300

国債短期証券入札予定

6月2日	3ヶ月(第1160回)
6月8日	6ヶ月(第1161回)
6月9日	3ヶ月
6月15日	3ヶ月

国債入札予定

6月6日	30年
6月22日	5年
6月27日	20年
6月29日	2年

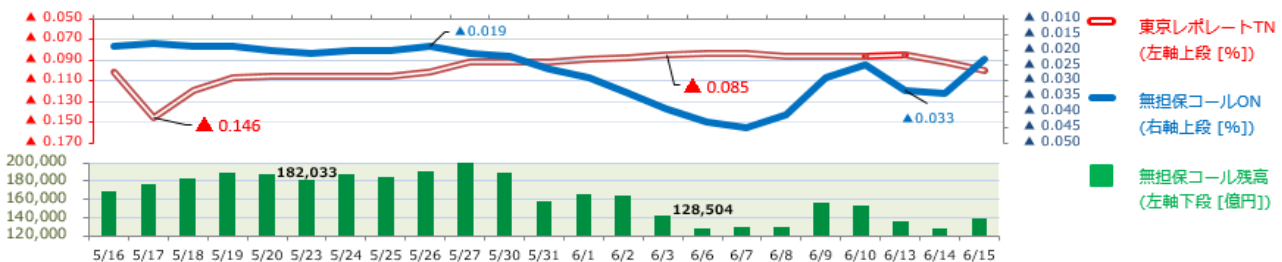
今月の国債買入オペ予定

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	1
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	2 9 15 23	5月24日	4
3年超5年以下	4,250~7,250	5,000	2 9 23 30	5月29日	4
5年超10年以下	4,750~8,750	5,750	9 15 23 30	5月29日	4
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	2 15 23 30	5月29日	4
25年超	500~3,500	1,000	9 15 30	5月29日	3
物価連動債	600	600	月1回	5月29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の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