



### 短期市場の推移

	5月29日	5月30日	5月31日	6月1日
加重平均金利	▲0.062	▲0.064	▲0.071	▲0.070
東京レボレート(TN)	▲0.151	▲0.163	▲0.126	▲0.141
無コール残	162,964	170,952	159,567	165,556
ON	87,391	94,899	91,524	89,193
その他	75,573	76,053	68,043	76,363
有コール残	23,413	23,644	24,158	22,986

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	▲0.072	▲0.102
T/N	-	-	-	▲0.116
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.060	▲0.138
2W	-	-	-	▲0.144
3W	-	-	-	▲0.152
1M	-	-	0.250	▲0.174
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.162
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

### 6月5日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		(米)5月ISM非製造業指数	

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.070%の出合から始まり、その後は主に▲0.080%~▲0.070%の水準で取引された。ビット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▲0.002%の▲0.072%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.075	▲0.080 ~ ▲0.073	▲0.080 ~ ▲0.070

### 翌営業日のマーケット

ビットオファー共に動向に大きな変化はなく、出合水準は横ばい圏を想定。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	6月2日		6月5日		6月6日
券	+700		+700		+1,000
財政	▲56,100		▲4,100		▲3,000
過不足	▲55,400		▲3,400		▲2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入				+12,300	
CP等買入			▲300		
社債等買入	▲800				
国債補充供給	+30,800	▲34,100	+34,100		
成長基盤強化支援	▲4,600				
当座預金増減	▲64,100		+42,700		▲2,000
当座預金残高	5,336,200		5,378,900		5,376,900
準備預金残高	4,637,100		主な需給要因		
積み終了先	4,636,700				
超過準備	4,636,700				
非準備先残高	699,100				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	64.5%				
乖離率	35.4%				

### 6月2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)(6/5~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(6/5~)						
~1年	1,500	3,774	1,500	▲0.017	0.009	10.0
1~3年	4,250	7,976	4,252	▲0.005	▲0.004	49.8
3~5年	4,500	10,610	4,505	▲0.004	▲0.003	36.1
10~25年	2,000	4,480	2,006	▲0.001	0.001	63.8
国債補充供給(6/2~6/5)						
	34,089	34,089	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)  
 6月1日時点 6,658,500

所要	(億円)
今積期の所要準備額	4,008,700
6月5日以降の残り所要	
積数	3,100
平均	300

### 国庫短期証券入札予定

6月8日	6ヶ月(第1161回)
6月9日	3ヶ月(第1162回)
6月15日	3ヶ月
6月19日	1年
6月6日	30年
6月22日	5年
6月27日	20年
6月29日	2年

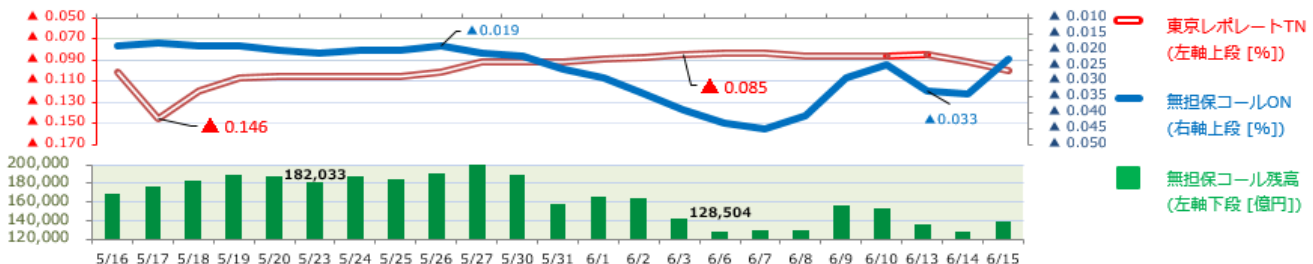
### 今月の国債買入オペ予定

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	6月2日	0
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	2 9 15 23	6月2日	3
3年超5年以下	4,250~7,250	4,500	2 9 23 30	6月2日	3
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	6月2日	3
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