



短期市場の推移

	5月30日	5月31日	6月1日	6月2日
加重平均金利	▲0.064	▲0.071	▲0.070	▲0.072
東京レポレート(TN)	▲0.163	▲0.126	▲0.141	▲0.116
無コール残	170,952	159,567	165,556	166,029
ON	94,899	91,524	89,193	85,846
その他	76,053	68,043	76,363	80,183
有コール残	23,644	24,158	22,986	24,727

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	▲0.068	▲0.098
T/N	-	-	-	▲0.102
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	▲0.030	▲0.062	▲0.132
2W	▲0.065	0.030	▲0.047	▲0.140
3W	-	-	-	▲0.148
1M	-	-	0.005	▲0.175
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.161
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6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▲0.070%の合出から始まり、その後は主に▲0.075%~ ▲0.065%の水準で取引された。一部ビッドサイドの調達ニーズの高まりもあり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.004%の▲0.068%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.073	▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.075 ~ ▲0.065

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲は強く、出会い水準は本日対比若干の上昇を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月5日	6月6日	6月6日	6月7日	6月7日	6月7日
券	+700	+1,100	+1,100	+0	+0	+0
財政	▲4,600	▲4,200	▲4,200	▲9,000	▲9,000	▲9,000
過不足	▲3,900	▲3,100	▲3,100	▲9,000	▲9,000	▲9,000
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
国債買入		+12,300				
CP等買入	▲300		▲400			
社債等買入			▲400			
国債補完供給	+34,100	▲34,100	+34,100			
共通担保(全店)						▲7,700
当座預金増減	+8,100	+30,200	+30,200	▲9,000	▲9,000	▲9,000
当座預金残高	5,344,300	5,374,500	5,374,500	5,365,500	5,365,500	5,365,500
準備預金残高	4,652,300	主な需給要因				
積み終了先	4,651,900	国債発行(30年)				
超過準備	4,651,900					
非準備先残高	692,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	67.7%					
乖離率	32.2%					

6月5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)(6/6~)	5~10年	0	0
5~10年	0	0	
5~10年	0	0	
5~10年	0	0	
国債補完供給(6/5~6/6)	33,926	33,926	▲0.350 ▲0.350
	84	84	▲0.350 ▲0.350

マネタリーベース (億円)
6月2日時点 6,593,700

所要	(億円)
今積期の所要準備額	4,008,700
6月6日以降の残り所要	
積数	2,700
平均	300

国債短期証券入札予定

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
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

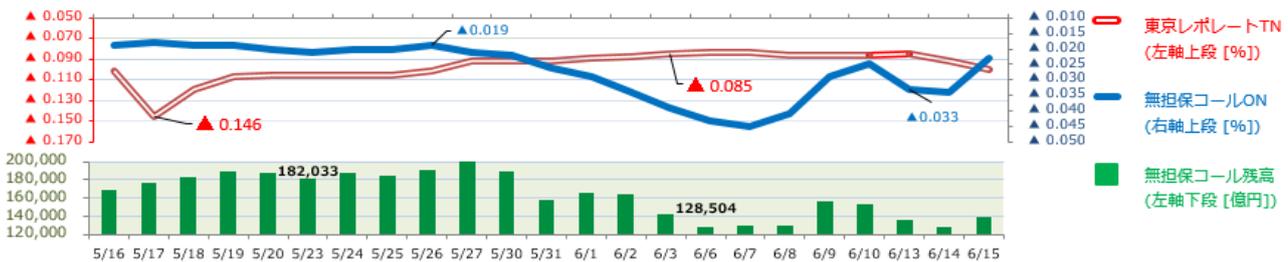
今月の国債買入オペ予定

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	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