



短期市場の推移

[億円] [%]

	5月20日	5月21日	5月22日	5月23日
加重平均金利	0.478	0.477	0.476	0.477
東京レボレート(TN)	0.493	0.494	0.491	0.493
無コール残	90,152	87,816	85,627	83,394
ON	39,601	37,715	36,026	34,863
その他	50,551	50,101	49,601	48,531
有コール残	31,106	30,959	31,725	32,256

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	0.450	0.478	0.476	0.492
T/N	-	-	-	0.491
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.524	0.476
2W	-	-	0.478	0.474
3W	-	-	-	0.472
1M	-	-	-	0.473
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.590	0.481
6M	-	-	-	0.497
1Y	-	-	-	0.573

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27日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
9:00	植田日銀総裁、あいさつ			(米) 消費者信頼感指数(5月)	
	-			-	
	-			-	

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の0.476%となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477

翌営業日のマーケット

出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月26日		5月27日		5月28日	
券		+0		+500		+1,000
財政		+2,000		+7,200		▲2,000
過不足		+2,000		+7,700		▲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
国債買入		+9,600				
共通担保(全店)					▲8,000	
CP等買入	▲200		▲300			
国債補完供給	+1,400	▲1,200	+1,200			
当座預金増減		+11,600		+8,600		▲9,000
当座預金残高		5,327,400		5,336,000		5,327,000
準備預金残高		4,839,600	主な需給要因			
積み終了先		4,837,800	流動性供給			
超過準備		4,837,800				
非準備先残高		487,800				
準備預金進捗率		99.8%				
平均		35.5%				
乖離率		64.3%				

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

国債補完供給(5/26~5/27)

1,170	1,170	0.250	0.250
0	0		

マネタリーベース [億円]

5月23日時点 6,537,000

所要

[億円]

今積期の所要準備額	4,107,900
5月27日以降の残り所要	
積数	8,800
平均	400

国庫短期証券入札予定

5月30日	3ヶ月(第1309回)
6月6日	3ヶ月
6月9日	6ヶ月
6月13日	3ヶ月

国債入札予定

5月28日	40年
5月30日	2年
6月3日	10年
6月5日	30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	1000	1,000	7	14	19	23	5月7日	0
1年超3年以下	2750	2,750	7	14	19	23	5月23日	0
3年超5年以下	2750	2,750	7	19	23	29	5月23日	1
5年超10年以下	3000	3,000	14	19	23	29	5月23日	1
10年超25年以下	1350	1,350	14	23	29		5月23日	1
25年超	750	750	7	19			5月19日	0
物価連動債	500	500	29				4月25日	1
変動利付債	-	300					4月14日	-

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