



短期市場の推移

[億円] [%]

	5月23日	5月26日	5月27日	5月28日
加重平均金利	0.477	0.476	0.476	0.476
東京レボ レート(TN)	0.493	0.491	0.488	0.467
無コール残	83,394	83,412	84,938	81,601
ON	34,863	34,011	35,137	32,462
その他	48,531	49,401	49,801	49,139
有コール残	32,256	32,240	31,487	31,205

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	0.488
T/N	-	-	-	0.467
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.473
2W	-	-	0.530	0.473
3W	-	-	-	0.471
1M	-	-	0.560	0.472
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.481
6M	-	-	-	0.500
1Y	-	-	-	0.572

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

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	5月29日	5月30日	5月30日	6月2日	
券		+200	+700	+1,000	
財政		▲11,000	▲6,200	▲14,000	
過不足		▲10,800	▲5,500	▲13,000	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	
国債買入			+7,400		
社債等買入			▲100		
国債補完供給	+1,000	▲1,600	+1,600		
成長基盤強化支援				▲2,600	
当座預金増減		▲11,400	+3,400	▲15,600	
当座預金残高		5,320,300	5,323,700	5,308,100	
準備預金残高		4,829,600	主な需給要因		
積み終了先		4,829,000	国庫短期証券発行償還		
超過準備		4,828,900	(3M)		
非準備先残高		490,700	国債発行償還(2年)		
準備預金進捗率		99.9%			
平均		45.2%			
乖離率		54.7%			

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30日	2年
6月3日	10年
6月5日	30年
6月19日	5年

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオペ金額	直近オペ額	オペ予定日	直近日	残り回数
1年以下	1000	1,000	7		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29日 0
5年超10年以下	3000	3,000	14 19 23 29		5月29日 0
10年超25年以下	1350	1,350	14 23 29		5月29日 0
25年超	750	750	7 19		5月19日 0
物価連動債	500	500	29		5月29日 0
変動利付債	-	300	-		4月14日 -

5月30日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	4月の完全失業率		(米)	4月の個人消費支出	
8:30	4月の有効求人倍率		-		
	-		-		

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)は前営業日対比横ばいの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\$

5月29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(5/30~)						
3~5年	2,750	6,428	2,753	▲0.009	▲0.007	55.4
5~10年	3,000	7,460	3,003	▲0.013	▲0.009	5.0
10~25年	1,350	3,705	1,353	0.004	0.004	72.9
物価連動	500	1,999	500	▲0.380	▲0.520	1.0
国債補完供給(5/29~5/30)						
	1,697	1,697	0.250	0.250		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

5月28日時点 6,552,100

所要

今積期の所要準備額		4,107,900
5月30日以降の残り所要		
積数	5,000	
平均	300	

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