



短期市場の推移

	[億円] [%]			
	5月24日	5月27日	5月28日	5月29日
加重平均金利	0.078	0.078	0.077	0.078
東京レポレート(TN)	0.079	0.048	0.041	0.051
無コール残	78,600	75,707	74,804	76,749
ON	35,247	32,154	31,234	33,079
その他	43,353	43,553	43,570	43,670
有コール残	39,563	38,996	38,852	39,806

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	0.060	0.125	0.077	0.039
T/N	-	-	-	0.033
S/N	-	-	-	-
1W	0.110	0.125	0.120	0.055
2W	0.100	0.180	0.138	0.058
3W	-	-	-	0.058
1M	-	-	0.130	0.057
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.083
6M	-	-	-	0.122
1Y	-	-	-	0.199

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

5月31日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	鉱工業生産速報(4月)		(米)	個人消費支出(4月)	
19:00	外国為替平衡操作の実施状況(5月)		(欧)	消費者物価(速報)(5月)	
	-			-	

本日の市況

無担保コールON物は0.078%の出合から始まり、その後も主に0.075%~0.078%を中心に取引された。ビットサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の0.077%となった。

都銀・信託		証券	地銀	
-	~ -	- ~ -	0.075	~ 0.078

翌営業日のマーケット

週末3日積み要因によりビットサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であり、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	5月30日	5月31日	5月31日	6月3日	6月3日
券	+600	+400	+400	+1,000	+1,000
財政	▲900	▲5,200	▲5,200	▲30,000	▲30,000
過不足	▲300	▲4,800	▲4,800	▲29,000	▲29,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
CP等買入		▲2,300	+3,000		
国債補完供給	+28,500	▲30,300	+30,300		
成長基盤強化支援				▲2,000	
当座預金増減	▲2,100	+26,200	+26,200	▲31,000	▲31,000
当座預金残高	5,521,200	5,547,400	5,547,400	5,516,400	5,516,400
準備預金残高	4,867,600	主な需給要因			
積み終了先	4,866,700	法人税、消費税、保険			
超過準備	4,866,700	揚げ			
非準備先残高	653,600	国債発行償還(2年)			
準備預金進捗率	99.9%				
平均	48.4%				
乖離率	51.5%				

5月30日のオペ結果

[%][億円]※ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(5/30~5/31)	31,250	31,250	▲0.150	▲0.150		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
5月29日時点 6,766,200

所要		[億円]
今積期の所要準備額		4,079,800
5月31日以降の残り所要		
積数		5,200
平均		300

国庫短期証券入札予定

5月31日	3ヶ月(第1234回)
6月6日	6ヶ月(第1235回)
6月7日	3ヶ月
6月13日	3ヶ月
国債入札予定	
6月4日	10年
6月6日	30年
6月20日	5年
6月25日	20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7日	0
1年超3年以下	3,000~4,500	3,750	7 13 17 23	5月23日	0
3年超5年以下	3,500~5,000	4,250	7 17 23 31	5月23日	1
5年超10年以下	4,000~5,500	4,250	13 17 23 31	5月23日	1
10年超25年以下	1,000~2,000	1,500	7 13 31	5月13日	1
25年超	500~1,000	750	17 31	5月17日	1
物価連動債	600	600	月1回	4月24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