



短期市場の推移

	5月30日	5月31日	6月3日	6月4日
加重平均金利	0.077	0.077	0.077	0.077
東京レポレート(TN)	0.033	0.071	0.069	0.066
無コール残	76,284	83,324	78,190	80,530
ON	32,344	38,974	33,560	35,300
その他	43,940	44,350	44,630	45,230
有コール残	39,471	38,278	38,281	38,594

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	0.070	0.078	0.077	0.079
T/N	-	-	-	0.069
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.061
2W	-	-	-	0.059
3W	-	-	0.190	0.058
1M	-	-	0.240	0.058
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.087
6M	-	-	-	0.133
1Y	-	-	-	0.201

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)

時刻	日本	予想	海外	予想
10:30	中村日銀審議委員 金融経済懇談会に出席・会見 (札幌市)		(米)貿易収支 (4月)	
	-		(欧)1-0圏 ラガルドECB 総裁の会見	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は0.078%の出合から始まり、その後は主に0.075%~0.078%を中心に取引された。ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの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

引き続きビッドサイドの資金調達ニーズは底堅く、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

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	+500		+400		+0	
財政	▲26,200		+700		▲9,000	
過不足	▲25,700		+1,100		▲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
CP等買入	▲100					
国債補充供給	+35,900	▲35,400	+35,400			
当座預金増減	▲25,300		+36,500		▲9,000	
当座預金残高	5,384,000		5,420,500		5,411,500	
準備預金残高	4,741,900		主な需給要因			
積み終了先	4,741,900					
超過準備	4,741,100					
非準備先残高	642,100					国債発行(30年)
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

[%][億円] ※米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
国債補充供給(6/5~6/6)	36,449	36,449	▲0.150	▲0.150		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
6月4日時点 6,649,400

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,079,800
6月6日以降の残り所要	
積数	600
平均	100

国庫短期証券入札予定

6月6日	6ヶ月(第1235回)
6月7日	3ヶ月(第1236回)
6月13日	3ヶ月
6月19日	1年

国債入札予定

6月6日	30年
6月20日	5年
6月25日	20年
6月27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
			月1回	月2回	月3回	月4回		
1年以下	1500	1,500					5月7日	1
1年超3年以下	3,000~4,500	3,750	7	12	18	24	5月23日	4
3年超5年以下	3,500~5,000	4,250	12	18	24	28	5月31日	4
5年超10年以下	4,000~5,500	4,250	7	12	18	24	5月31日	4
10年超25年以下	1,000~2,000	1,500	7	18	28		5月31日	3
25年超	500~1,000	750	12	28			5月31日	2
物価連動債	600	600	月1回				5月31日	1
変動利付債	-	300	-				2023/4/14	-

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