

2020年5月29日(金)

短期市場の推移

[億円] [%]

	5月25日	5月26日	5月27日	5月28日
加重平均金利	▲0.059	▲0.060	▲0.059	▲0.057
東京レポレート(ON)	▲0.070	▲0.081	▲0.089	▲0.110
無コール残	116,885	119,629	122,911	124,026
ON	70,456	72,680	74,652	75,327
その他	46,429	46,949	48,259	48,699
有コール残	20,069	17,953	20,663	18,032

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	▲0.073	▲0.106
T/N	-	-	▲0.080	▲0.073
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.080	▲0.001	▲0.060	▲0.091
2W	▲0.070	▲0.015	▲0.024	▲0.094
3W	-	-	-	▲0.099
1M	-	-	-	▲0.104
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.119
6M	-	-	-	▲0.163
1Y	-	-	-	▲0.187

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1日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
13:00	日銀当座預金増減要因と金融調節(5月実績)	-	米 ISM製造業指数(5月)	-
	-	-	-	-
	-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.075%の出合から始まり、その後は主に▲0.080%~▲0.050%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比▲0.016%の▲0.073%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.075	- ~ -	▲0.080 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

調達を控えていた先が戻り、出合水準は本日対比で上昇する見込み。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	5月29日	6月1日	6月2日
券	▲900	▲100	+1,000
財政	+14,100	▲76,000	+2,000
過不足	+13,200	▲76,100	+3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+8,700	
CP等買入	▲2,100	+8,000	
国債補完供給	+300	▲100	+100
当座預金増減	+19,300	▲67,300	+3,000
当座預金残高	4,271,400	4,204,100	4,207,100
準備預金残高	3,681,900	主な需給要因	
積み終了先	3,681,600	国債発行・償還(2年)	
超過準備	3,681,500	国庫短期証券発行(3M・6M)	
非準備先残高	589,500	国庫短期証券償還(6M)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	51.6%		
乖離率	48.3%		

5月29日のオペ結果 [円][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

国債買入(6/1~)						
3~5年	3,500	7,349	3,502	▲0.002	0.000	27.4
5~10年	3,700	9,502	3,705	0.000	0.001	91.1
10~25年	1,200	4,817	1,208	0.004	0.005	19.6

米ドル資金供給(6/2~6/9)

	0	0	0.300	0.300
国債補完供給(5/29~6/1)	63	63	▲0.350	▲0.350
	0	0		

マネタリーベース [億円]
5月28日時点 5,414,200

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,360,900
6月1日以降の残り所要	
積数	3,800
平均	300

国庫短期証券入札予定

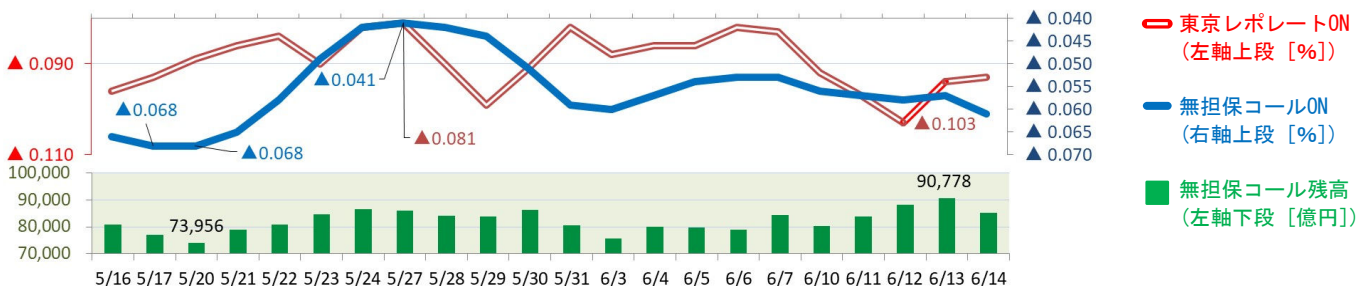
6月5日	3ヶ月	第912回
6月9日	6ヶ月	
6月12日	3ヶ月	
6月15日	6ヶ月	
国債入札予定		
6月2日	10年	
6月4日	30年	
6月18日	5年	
6月25日	20年	

来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	500~1,000	800	月3回程度	5月21日	3
1年超3年以下	2,000~5,000	3,400	1 5 12 17 22 26	5月25日	6
3年超5年以下	2,000~4,500	3,500	3 5 10 12 22 26	5月29日	5
5年超10年以下	2,500~5,500	3,700	5 10 17 22 29	5月29日	5
10年超25年以下	500~2,000	1,200	3 29	5月29日	2
25年超	0~500	300	1 17	5月19日	2
物価連動債	300	300	月2回程度	5月25日	2
変動利付債<偶数月>	1,000	1,000	1回	4月6日	1

1年前の市場推移 ○2019年5月積み期 [5月16日~6月14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(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会