

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年6月1日(月)

短期市場の推移

[億円] [%]

	5月26日	5月27日	5月28日	5月29日
加重平均金利	▲0.060	▲0.059	▲0.057	▲0.073
東京レポレート(ON)	▲0.081	▲0.089	▲0.110	▲0.106
無コール残	119,629	122,911	124,026	120,286
ON	72,680	74,652	75,327	75,002
その他	46,949	48,259	48,699	45,284
有コール残	17,953	20,663	18,032	17,640

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	▲0.058	▲0.097
T/N	-	-	▲0.080	▲0.096
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.065	▲0.030	▲0.056	▲0.099
2W	▲0.070	0.000	▲0.057	▲0.100
3W	-	-	▲0.080	▲0.102
1M	-	-	-	▲0.108
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.121
6M	-	-	-	▲0.164
1Y	-	-	-	▲0.188

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2日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	5月マネタリーベース(日銀)	-	(欧)5月製造業PMI(確報)	-
10:00	営業毎旬報告(5月31日現在)	-	-	-
	-	-	-	-

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▲0.065%の出合から始まり、その後は主に▲0.070%~▲0.050%の水準で出合が見られた。大手行を中心に調達ニーズが強く、同加重平均金利(速報)は、前営業日対比+0.015%の▲0.058%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	▲0.080 ~ ▲0.055	-	▲0.080 ~ ▲0.040

翌営業日のマーケット

出合の水準は本日対比横ばいを予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	6月1日	6月2日	6月3日
券	▲200	▲800	+1,000
財政	▲74,900	▲24,200	▲72,000
過不足	▲75,100	▲25,000	▲71,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	▲8,700	+4,000	スタート
CP等買入		▲100	
社債等買入		▲100	
国債補完供給	+100	+700	
成長基盤強化支援			▲6,100 +2,000
当座預金増減	▲67,000	▲20,500	▲75,100
当座預金残高	4,204,400	4,183,900	4,108,800
準備預金残高	3,634,400	主な需給要因	
積み終了先	3,634,000	法人税・消費	
超過準備	3,634,000	税・保険揚げ	
非準備先残高	570,000	普通交付税	
準備預金進捗率	99.9%	国債発行(10年)	
平均	54.8%		
乖離率	45.1%		

6月1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

国債買入(6/2~)						
1~3年	3,400	8,299	3,405	▲0.002	0.000	96.7
25年~	300	1,312	302	0.013	0.014	46.6
物価連動	300	1,348	301	▲0.170	▲0.226	37.5

米ドル資金供給(6/3~6/10)

	172	172	0.300	0.300
--	-----	-----	-------	-------

国債補完供給(6/1~6/2)

	702	702	▲0.350	▲0.350
--	-----	-----	--------	--------

	0	0		
--	---	---	--	--

マネタリーベース[億円]
5月29日時点 5,434,300

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,360,900
6月2日以降の残高	
積数	3,400
平均	200

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	

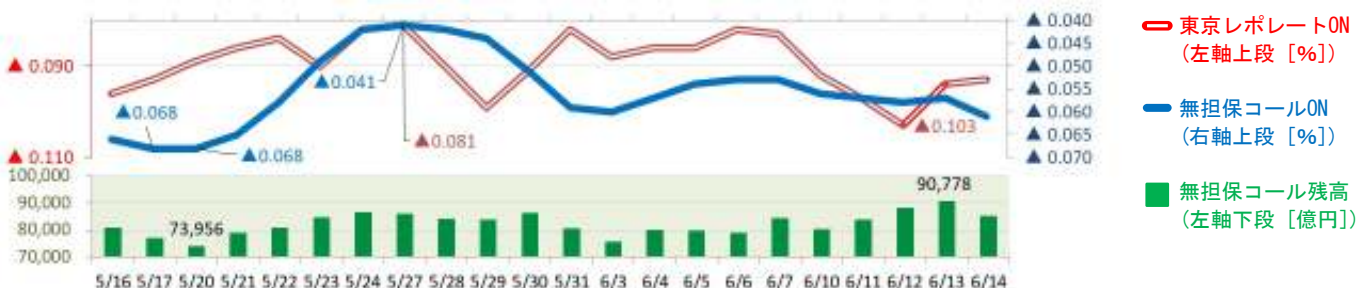
今月の国債買入オペ予定

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	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	6月1日	5
3年超5年以下	2,000~4,500	3,500	3 5 10 12 22 26	5月29日	6
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	6月1日	1
物価連動債	300	300	月2回程度	6月1日	1
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