

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年6月2日(火)

## 短期市場の推移

	5月27日	5月28日	5月29日	6月1日
加重平均金利	▲0.059	▲0.057	▲0.073	▲0.058
東京レポレート(ON)	▲0.089	▲0.110	▲0.106	▲0.097
無コール残	122,911	124,026	120,286	129,682
ON	74,652	75,327	75,002	82,478
その他	48,259	48,699	45,284	47,204
有コール残	20,663	18,032	17,640	20,360

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。

## 6月3日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 日銀当座預金増減要因(6月見込み)	-	21:15 (米)5月ADP全米雇用報告	-950万人
		23:00 (米)5月ISM非製造業景況指数	44.0
		(米)週間のMBA住宅ローン申請指数	

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

## 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	▲0.085	0.001	▲0.059	▲0.098
T/N	-	-	▲0.010	▲0.110
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	▲0.060	▲0.066	▲0.103
2W	▲0.070	▲0.010	▲0.061	▲0.103
3W	-	-	-	▲0.105
1M	-	-	-	▲0.110
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.123
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

## 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.060%の出合から始まり、その後は主に▲0.070%~▲0.040%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▲0.001%の▲0.059%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.060	-	▲0.070 ~ ▲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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月2日		6月3日		6月4日	
券		▲900		+0		+0
財政		▲24,800		▲46,200		+2,000
過不足		▲25,700		▲46,200		+2,000
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
国庫短期証券買入				+30,000		
国債買入		+4,000				
CP等買入	▲100		▲300			
社債等買入	▲100		▲100			
ETF買入				+100		
国債補完供給	+700	▲400	+400			
米ドル資金供給用担保国債供給				▲1,000		
成長基盤強化支援			▲4,500	+2,000		
当座預金増減		▲21,600		▲19,600		+2,000
当座預金残高		4,182,800		4,163,200		4,165,200
準備預金残高		3,609,900				
積み終了先		3,609,700				
超過準備		3,609,700				
非準備預金残高		572,900				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		58.1%				
乖離率		41.8%				
			法人税・消費税・保険揚げ			
			普通交付税			
			国債発行(10年)			

## 6月2日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国庫短期証券買入(6/3~)	30,000	49,473	30,004	0.000	0.003	44.7
米ドル資金供給(6/4~6/11)		2,747		0.300		0.300
米ドル資金供給(6/4~8/27)		1,355	1,355	0.300		0.300
国債補完供給(6/2~6/3)		389	389	▲0.350	▲0.350	
		0	0			
米ドル資金供給用担保国債供給(6/3~8/28)	5,000	947	947	▲0.100	▲0.100	

マナタリーベース [億円]  
6月1日時点 5,367,400

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,360,900  
6月3日以降の残り所要積数 3,100  
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	第913回
6月12日	3ヶ月	
6月15日	6ヶ月	
6月4日	30年	
6月18日	5年	
6月25日	20年	
6月30日	2年	

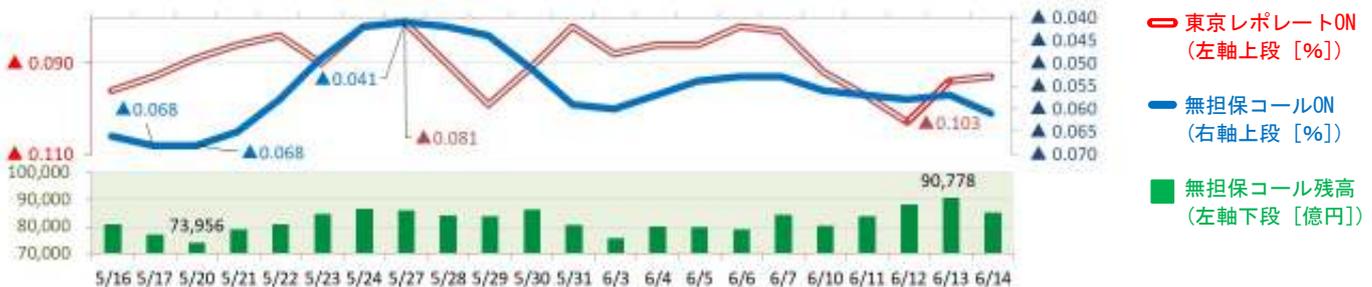
## 今月の国債買入オペ予定

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
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