



短期市場の推移

	5月24日	5月25日	5月26日	5月27日
加重平均金利	▲0.015	▲0.016	▲0.018	▲0.021
東京レボレート(TN)	▲0.100	▲0.100	▲0.117	▲0.110
無コール残	144,010	144,610	143,867	141,534
ON	82,242	81,232	81,469	79,836
その他	61,768	63,378	62,398	61,698
有コール残	21,744	20,120	19,512	21,580

加重平均金利、コール残高は日銀、東京レボ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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.080	0.001	▲0.025	▲0.093
T/N	▲0.018	▲0.001	▲0.005	▲0.100
S/N	-	-	▲0.013	-
1W	▲0.025	▲0.010	▲0.019	▲0.102
2W	-	-	▲0.025	▲0.102
3W	-	-	-	▲0.103
1M	-	-	▲0.015	▲0.104
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.109
6M	-	-	-	▲0.116
1Y	-	-	-	▲0.136

無担保コール(速報)は日銀、東京レボ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
11:00	決済動向(4月)	-	(米) 休日 (メモリアルデー)	
	-		-	
	-		-	

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▲0.008%の出合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.010%の水準で出合が見られた。週末3日積みではあるものの、昨日に引き続き地銀業態を中心に調達ニーズの弱まりが見られ、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.004%の▲0.025%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.035	▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.045 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達ニーズは弱く、出合水準は本日対比で若干の低下を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	5月28日	5月31日	5月31日	6月1日	6月1日
券	▲100	+700	+700	+1,000	+1,000
財政	+8,000	▲7,900	▲7,900	▲22,000	▲22,000
過不足	+7,900	▲7,200	▲7,200	▲21,000	▲21,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入			+11,400		
CP等買入	▲400		▲3,800	+4,000	
E T F買入	+400				
国債補完供給	▲200	+200			
当座預金増減	+7,700	+4,600	+4,600	▲21,000	▲21,000
当座預金残高	5,292,700	5,297,300	5,297,300	5,276,300	5,276,300
準備預金残高	4,619,000				
積み終了先	4,618,600	国庫短期証券発行・償還(3M)			
超過準備	4,618,600				
非準備先残高	673,700				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	48.4%				
乖離率	51.5%				

5月28日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(5/31~)						
~1年	1,500	2,878	1,501	▲0.005	0.000	5.9
3~5年	4,500	13,469	4,505	0.006	0.007	38.2
5~10年	4,500	10,392	4,510	0.009	0.010	37.3
物価連動	600	2,783	600	▲0.190	▲0.289	56.0
国債補完供給(5/28~5/31)						
	234	234	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
5月27日時点 6,495,500

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,743,300
5月31日以降の残り所要	
積数	1,300
平均	100

国庫短期証券入札予定

6月4日	3ヶ月(第998回)
6月9日	6ヶ月
6月11日	3ヶ月
6月15日	6ヶ月
5月31日	2年
6月3日	10年
6月8日	30年
6月22日	5年

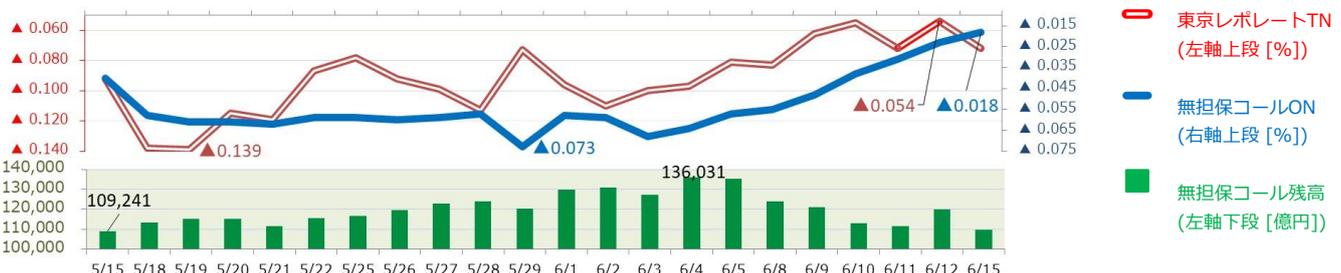
今月の国債買入オペ予定

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
6月9日以下	1500	1,500	月1回程度	5月28日	0
1年超3年以下	4750	4,750	10 14 20 24	5月24日	0
3年超5年以下	4500	4,500	10 14 24 28	5月28日	0
5年超10年以下	4500	4,500	6 14 20 28	5月28日	0
10年超25年以下	2000	2,000	6	5月6日	0
25年超	500	500	20	5月20日	0
物価連動債	600	600	月1回程度	5月28日	0
変動利付債<四半期>	300	300	-	4月21日	-

1年前の市場推移

○2020年5月積み期 [5月15日~6月15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(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会