



デイリーシグナル

2021年5月31日(月)

短期市場の推移 [徳円] [%]

	5月25日	5月26日	5月27日	5月28日
加重平均金利	▲0.016	▲0.018	▲0.021	▲0.025
東京レポレート(TN)	▲0.100	▲0.117	▲0.110	▲0.100
無コール残	144,610	143,867	141,534	142,763
ON	81,232	81,469	79,836	83,605
その他	63,378	62,398	61,698	59,158
有コール残	20,120	19,512	21,580	21,964

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	▲0.080	0.001	▲0.034	▲0.093
T/N	▲0.020	▲0.001	▲0.006	▲0.097
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.010	▲0.013	▲0.101
2W	-	-	-	▲0.101
3W	-	-	-	▲0.102
1M	-	-	▲0.003	▲0.104
2M	-	-	0.004	-
3M	-	-	-	▲0.109
6M	-	-	-	▲0.116
1Y	-	-	-	▲0.136

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
16:00	債券市場サーベイ (2021年5月調査)	-	18:00	(欧) ユーロ圏消費者物価 コア指数 (5月)	0.9%
	-		18:00	(欧) ユーロ圏失業率 (4月)	8.1%
	-		23:00	(米) ISM製造業景況 指数 (5月)	61.0

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▲0.020%の出合から始まり、その後は主に▲0.080%~▲0.010%のワイドレンジで出合が見られた。月末ということもあり、一部調達を控える先も散見され、昨日よりさらに地合が弱含んだ。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.009%の▲0.034%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.050	▲0.050 ~ ▲0.040	▲0.060 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの様子見姿勢は強く、出合水準は本日対比横ばいを予想。

資金需給 [徳円]

	日銀速報 5月31日	日銀予想 6月1日	当社需給予想 6月2日
券	+600	+500	+0
財政	▲5,400	▲40,000	▲45,000
過不足	▲4,800	▲39,500	▲45,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+11,400	
CP等買入	▲3,800	+4,000	
国債補完供給	+200		▲8,600
成長基盤強化支援			+2,600
当座預金増減	+7,000	▲39,500	▲51,000
当座預金残高	5,299,700	5,260,200	5,209,200
準備預金残高	4,627,800	主な需給要因	
積み終了先	4,627,500	国債	法人税・消費税
超過準備	4,627,500	発行・償還	・保険掛け
非準備先残高	671,900	(2年)	普通交付税交付金
準備預金進捗率	99.9%		
平均	51.6%		
乖離率	48.3%		

5月31日のオペ結果 [%][徳円] ※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
国債補完供給(5/31~6/1)	21	21	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [徳円]	所要 [徳円]
5月28日時点 6,503,400	今積期の所要準備額 3,743,300
	6月1日以降の残り所要
	積数 900
	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

国債入札予定

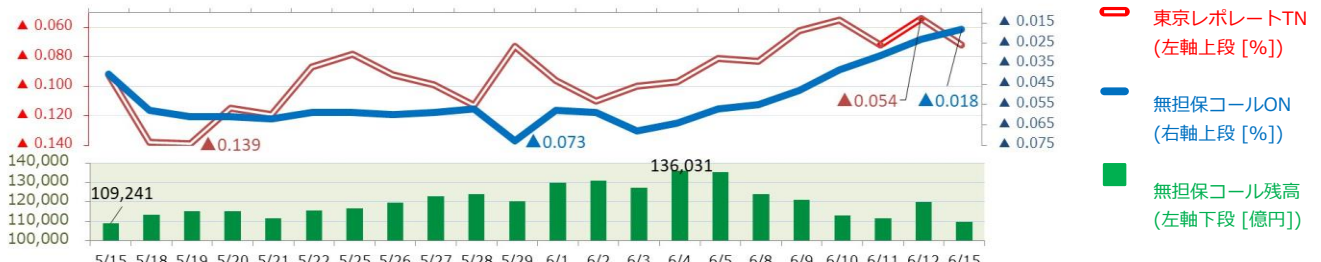
6月3日	10年
6月8日	30年
6月22日	5年
6月24日	20年

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	1500	1,500	月1回程度	5月28日	1
1年超3年以下	4750	4,750	2 9 16 23	5月24日	4
3年超5年以下	4500	4,500	2 9 16 28	5月28日	4
5年超10年以下	4500	4,500	9 16 23 28	5月28日	4
10年超25年以下	2000	2,000	2	5月6日	1
25年超	500	500	28	5月20日	1
物価運動債	600	600	月1回程度	5月28日	1
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