



短期市場の推移

	5月27日	5月28日	5月31日	6月1日
加重平均金利	▲0.021	▲0.025	▲0.034	▲0.038
東京レポレート(TN)	▲0.110	▲0.100	▲0.097	▲0.092
無コール残	141,534	142,763	134,658	140,661
ON	79,836	83,605	79,700	85,748
その他	61,698	59,158	54,958	54,913
有コール残	21,580	21,964	19,725	22,460

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	▲0.070	0.001	▲0.043	▲0.081
T/N	▲0.020	▲0.001	▲0.004	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.008	▲0.018	▲0.088
2W	▲0.013	▲0.005	▲0.009	▲0.092
3W	-	-	0.030	▲0.095
1M	-	-	-	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.107
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3日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
【記者会見要旨】 安達審議委員 (6月2日分)	-	21:15	ADP全米雇用報告 (5月)
-	-	21:30	新規失業保険申請件数
-	-	-	-

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▲0.025%の合出から始まり、その後は主に▲0.070%~▲0.020%で合出が見られた。引き続き地銀業態を中心に調達ニーズが弱く、昨日よりさらに軟調な地合となった。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.005%の▲0.043%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.060	▲0.050 ~ ▲0.040	▲0.070 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

引き続き地銀業態を中心に調達ニーズが弱く、出合水準は本日対比で横ばいからやや低下と予想。

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	+200	▲200	+0
財政	▲58,300	+100	▲26,000
過不足	▲58,100	▲100	▲26,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+5,000		
国債買入		+11,700	
CP等買入		▲100	
社債等買入	▲100	▲100	
国債補充供給	+300	+300	
成長基盤強化支援	▲7,200	+2,600	
当座預金増減	▲57,800	+11,700	▲26,000
当座預金残高	5,193,200	5,204,900	5,178,900
準備預金残高	4,557,100	主な需給要因	
積み終了先	4,556,700	国債発行 (10年)	
超過準備	4,556,700		
非準備先残高	636,100		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	58.1%		
乖離率	41.8%		

6月2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(6/3~)						
1~3年	4,750	18,187	4,762	0.000	0.001	17.7
3~5年	4,500	11,315	4,509	0.000	0.001	3.5
10~25年	2,000	6,445	2,010	0.004	0.005	54.9
米ドル資金供給(6/4~6/10)						
	0	0	0.310	0.310		
米ドル資金供給(6/4~8/26)						
	0	0	0.330	0.330		
国債補充供給(6/2~6/3)						
	337	337	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

6月1日時点 6,460,600

所要

今積期の所要準備額 3,743,300

6月3日以降の残り所要

積数 200

平均 0

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(第999回)
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

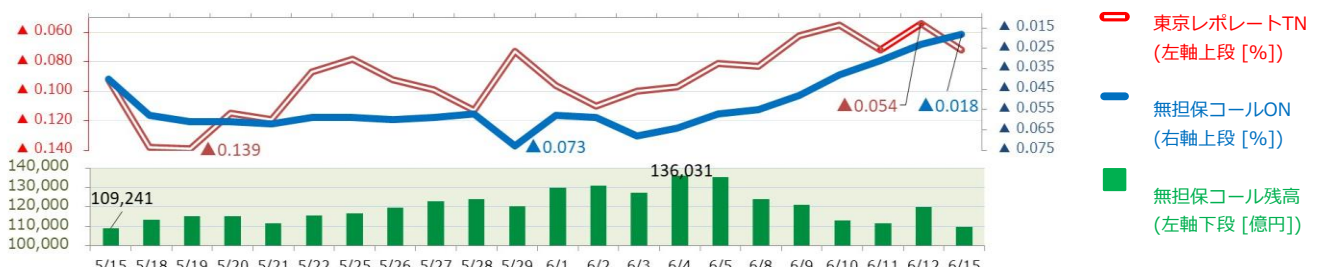
今月の国債買入オペ予定

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	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	6月2日	3
3年超5年以下	4500	4,500	2 9 16 28	6月2日	3
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 28	6月2日	0
25年超	500	500		5月20日	1
物価連動債	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