



短期市場の推移

	5月26日	5月27日	5月30日	5月31日
加重平均金利	▲0.019	▲0.021	▲0.022	▲0.026
東京レボレート(TN)	▲0.101	▲0.092	▲0.092	▲0.092
無コール残	191,276	208,619	189,356	157,993
ON	97,858	116,926	99,063	70,790
その他	93,418	91,693	90,293	87,203
有コール残	30,158	30,798	31,186	28,460

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	▲0.065	0.001	▲0.029	▲0.093
T/N	▲0.020	▲0.013	▲0.017	▲0.089
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	0.000	▲0.024	▲0.097
2W	▲0.040	0.100	▲0.030	▲0.101
3W	-	-	-	▲0.107
1M	-	-	-	▲0.116
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.113
6M	-	-	-	▲0.112
1Y	-	-	-	▲0.111

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

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月マナタリベース (日銀)		21:30	(米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
	-		21:15	(米)5月ADP全米雇用報告	29.5万人
	-			-	

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▲0.030%の出合から始まり、その後は主に▲0.035%~▲0.018%の水準で取引された。ビットサイドの資金調達ニーズ減退が一部見られたことで、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.003%の▲0.029%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.030 ~ ▲0.025	▲0.035 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

本日に引き続きビットサイドの慎重な動きから軟調な出合水準が継続すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	6月1日	6月2日	6月2日	6月3日	6月3日
券		+400		▲200	+0
財政		▲57,300		▲45,400	▲27,000
過不足		▲56,900		▲45,600	▲27,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+0	+5,000	+0	+5,000	+0
CP等買入				▲100	
国債補完供給	+2,200	▲2,700	+2,700		
成長基盤強化支援					▲5,200
当座預金増減		▲52,400		▲43,000	▲32,200
当座預金残高		5,435,500		5,392,500	5,360,300
準備預金残高		4,757,900	主な需給要因		
積み終了先		4,757,900	普通交付税	国債発行(10Y)	
超過準備		4,757,600	税保険揚げ		
非準備先残高		677,600			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		54.8%			
乖離率		45.1%			

6月1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(固定利回り方式)(6/2~)						
5~10年	0	0				
国債補完供給(6/1~6/2)						
2,610	2,610	▲0.350	▲0.350			
0	0					

マナタリベース	所要
5月31日時点 6,734,000	今積期の所要準備額 3,873,000
	6月2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3日	3ヶ月(第1084回)
6月9日	6ヶ月
6月10日	3ヶ月
6月14日	6ヶ月
国債入札予定	
6月2日	10年
6月7日	30年
6月21日	5年
6月23日	20年

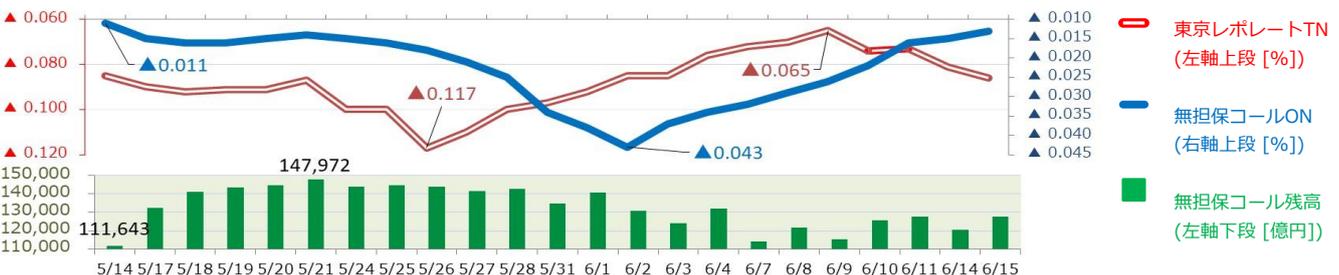
今月の国債買入オペ予定

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	5月9日	1
1年超3年以下	4750	4,750	3 8 15 22	5月25日	4
3年超5年以下	4750	4,750	3 8 15 29	5月30日	4
5年超10年以下	5000	5,000	8 15 22 29	5月30日	4
10年超25年以下	1250	1,250	8 29	5月25日	2
25年超	500	500	3 22	5月30日	2
物価連動債	600	600	月1回	5月30日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	4月8日	0

1年前の市場推移

○2021年5月積み期 [5月14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