



### 短期市場の推移

	5月27日	5月30日	5月31日	6月1日
加重平均金利	▲0.021	▲0.022	▲0.026	▲0.029
東京レポレート(TN)	▲0.092	▲0.092	▲0.092	▲0.089
無コール残	208,619	189,356	157,993	165,589
ON	116,926	99,063	70,790	84,736
その他	91,693	90,293	87,203	80,853
有コール残	30,798	31,186	28,460	29,542

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	▲0.034	▲0.089
T/N	▲0.020	▲0.015	▲0.018	▲0.087
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	-	-	-	▲0.095
2W	▲0.048	▲0.023	▲0.036	▲0.100
3W	-	-	-	▲0.106
1M	-	-	▲0.010	▲0.113
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.114
6M	-	-	-	▲0.112
1Y	-	-	-	▲0.112

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
-	-	21:30 (米)5月非農業部門雇用者数	32.9万人
-	-	21:30 (米)5月失業率	3.5%
-	-	23:00 (米)5月ISM非製造業景況指数	56.9

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%の合出から始まり、その後は主に▲0.035%~▲0.015%の水準で取引された。引き続きビッドサイドの調達意欲は弱まっており、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.005%の▲0.034%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.050	- ~ -	▲0.035 ~ ▲0.015

### 翌営業日のマーケット

週末3日積みとなるが、今積み期の資金繰りに目途を付けたビッドサイドが調達を控える動きもあり、出合いの水準は本日より低下を予想する。

### 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6日
券	▲200	+500	+2,000
財政	▲41,300	▲28,800	▲1,000
過不足	▲41,500	▲28,300	+1,000
金融調節	エンド	エンド	エンド
CP等買入	▲100	▲200	
社債等買入		▲100	
国債補完供給	+2,700	+1,500	
成長基盤強化支援		▲4,500	+3,200
当座預金増減	▲40,400	▲28,400	+1,000
当座預金残高	5,395,100	5,366,700	5,367,700
準備預金残高	4,720,000	主な需給要因	
積み終了先	4,720,000	国債発行(10年)	国庫短期証券
超過準備	4,720,000		発行・償還(3M)
非準備先残高	675,100		
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

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)(6/3~)						
5~10年	0	0				
国債補完供給(6/2~6/3)						
	1,499	1,499	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース	所要
6月1日時点	6,681,200

所要	所要
今積み期の所要準備額	3,873,000
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3日	3ヶ月(第1084回)
6月9日	6ヶ月(第1085回)
6月10日	3ヶ月
6月14日	6ヶ月
6月7日	30年
6月21日	5年
6月23日	20年
6月28日	2年

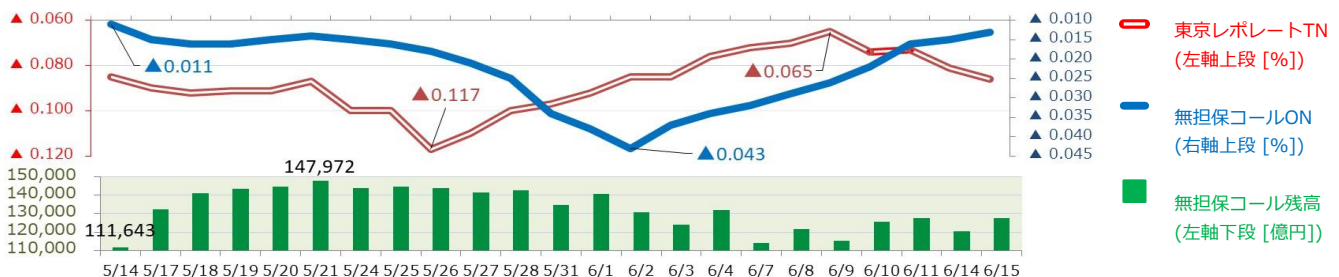
### 今月の国債買入オペ予定

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	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