



短期市場の推移

	5月26日	5月27日	5月28日	5月31日
加重平均金利	▲0.018	▲0.021	▲0.025	▲0.034
東京レポレート(TN)	▲0.117	▲0.110	▲0.100	▲0.097
無コール残	143,867	141,534	142,763	134,658
ON	81,469	79,836	83,605	79,700
その他	62,398	61,698	59,158	54,958
有コール残	19,512	21,580	21,964	19,725

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	▲0.038	▲0.090
T/N	▲0.020	▲0.001	▲0.006	▲0.092
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.096
2W	▲0.020	▲0.006	▲0.011	▲0.098
3W	-	-	▲0.007	▲0.101
1M	-	-	-	▲0.103
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.108
6M	-	-	-	▲0.115
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2日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:00	営業毎旬報告 (5月31日現在)	-	(米) MBA住宅ローン申請 指数	-
10:30	【挨拶】安達審議委員 (静岡)	-	-	-
	-	-	-	-

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%~▲0.015%で出合が見られた。月末でビッドを控えていた先が戻ってきたものの、昨日よりさらに地合が弱含み、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.004%の▲0.038%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からやや低下を予想

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1日	6月2日	6月1日	6月2日
券	+400	+200	+400	+200	+0	+0
財政	▲48,800	▲59,000	▲48,800	▲59,000	+1,000	+1,000
過不足	▲48,400	▲58,800	▲48,400	▲58,800	+1,000	+1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国庫短期証券買入				▲5,000		
社債等買入				▲100		
国債補完供給	▲300	+300	▲300	+300		
成長基盤強化支援			▲7,200	+2,600		
当座預金増減	▲48,700	▲58,200	▲48,700	▲58,200	+1,000	+1,000
当座預金残高	5,251,000	5,192,800	5,251,000	5,192,800	5,193,800	5,193,800
準備預金残高	4,599,700		4,599,700			
積み終了先	4,599,300		4,599,300			
超過準備	4,599,300		4,599,300			
非準備先残高	651,300		651,300			
準備預金進捗率	99.9%		99.9%			
平均	54.8%		54.8%			
乖離率	45.1%		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
国庫短期証券買入(6/2~)	5,000	23,022	5,002	0.003	0.003	100.0
国債補完供給(6/1~6/2)	267	267	▲0.350	▲0.350		
	42	42	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)
5月31日時点 6,509,700

所要	今積期の所要準備額
6月2日以降の残り所要	3,743,300
積数	600
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
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

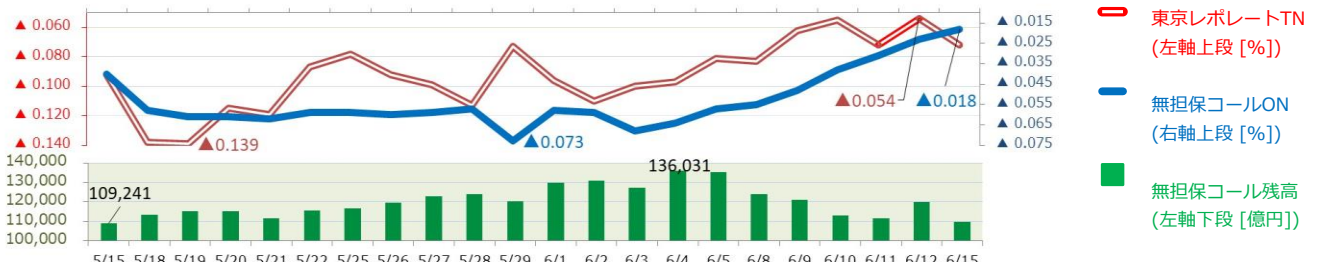
今月の国債買入オペ予定

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	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