



デイリーシグナル

2021年6月3日(木)

短期市場の推移

	5月28日	5月31日	6月1日	6月2日
加重平均金利	▲0.025	▲0.034	▲0.038	▲0.043
東京レボレート(TN)	▲0.100	▲0.097	▲0.092	▲0.085
無コール残	142,763	134,658	140,661	130,922
ON	83,605	79,700	85,748	75,859
その他	59,158	54,958	54,913	55,063
有コール残	21,964	19,725	22,460	20,142

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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.070	0.001	▲0.037	▲0.083
T/N	▲0.020	▲0.001	▲0.007	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	▲0.010	▲0.018	▲0.087
2W	▲0.015	▲0.010	▲0.014	▲0.089
3W	-	-	-	▲0.092
1M	-	-	-	▲0.098
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.105
6M	-	-	-	▲0.115
1Y	-	-	-	▲0.136

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4日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	特になし	-	(米)5月雇用統計
-	-	-	(米)1~3月非農業部門労働生産性(確報)
-	-	-	(米)パウエルFRB議長BIS討論会に参加

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▲0.060%~▲0.020%で出合が見られた。昨日に比べ調達ニーズがやや強まり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.006%の▲0.037%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.060	▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.055 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

週末3日積みとなるが調達ニーズの戻りは弱く、出合水準は本日対比で横ばいから小幅上昇に留まると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	6月3日	6月4日	6月4日	6月7日	6月7日
券		▲100	+500	+1,000	+1,000
財政		+300	▲21,400	▲2,000	▲2,000
過不足		+200	▲20,900	▲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
国債買入		+11,700			
CP等買入	▲100		▲100		
社債等買入	▲100		▲200		
国債補充供給	+300	▲200	+200		
当座預金増減		+11,800	▲21,000	▲1,000	▲1,000
当座預金残高		5,205,000	5,184,000	5,183,000	5,183,000
準備預金残高		4,577,500	主な需給要因		
積み終了先		4,577,500	国債発行(10年)	国庫短期証券発行償還	
超過準備		4,577,400		(3M)	
非準備先残高		627,500			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		61.3%			
乖離率		38.6%			

6月3日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(6/3~6/4)	216	216	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース (億円)
6月2日時点 6,402,500

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,743,300
6月4日以降の残り所要	
積数	100
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
6月8日	30年
6月22日	5年
6月24日	20年
6月29日	2年

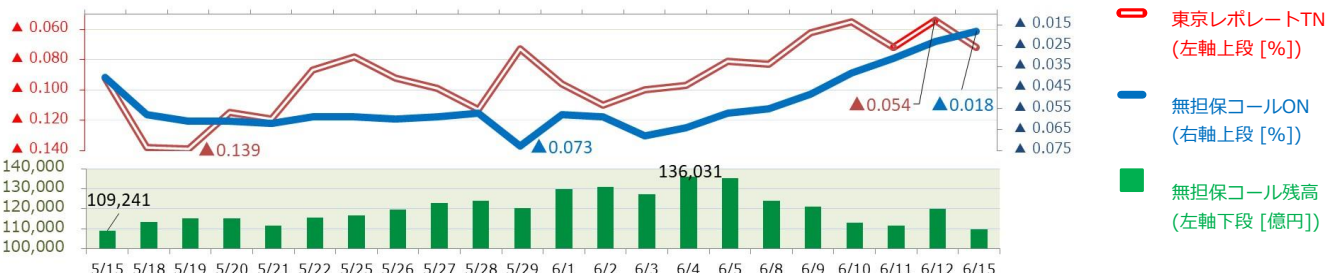
今月の国債買入オペ予定

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