



短期市場の推移

[億円][%]

5月31日の予定(時刻は日本時間)

	5月24日	5月25日	5月28日	5月29日
加重平均金利	▲0.070	▲0.071	▲0.069	▲0.070
東京レポレート(ON)	▲0.102	▲0.128	▲0.110	▲0.115
無コール残	66,199	68,024	58,424	61,135
ON	40,059	41,774	32,504	34,645
その他	26,140	26,250	25,920	26,490
有コール残	22,101	18,136	24,616	15,889

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。

日本		予想	海外		予想
8:50	4月鉱工業生産指数 [前月比]	+1.4%	21:30	(米)4月個人所得	0.3%
19:30頃	日銀当座預金増減要因と 金融調節(5月実績速報)	-	21:30	(米)4月個人消費支出	0.4%
	-		22:45	(米)5月シカゴ購買部 協会景気指数	58.1

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の短期市場金利

[%]

	無担保コール(速報)			レポ市場 東京レポ レート
	最低	最高	平均	
O/N	▲0.086	0.001	▲0.070	▲0.117
T/N	-	-	0.000	▲0.240
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.053	▲0.043	▲0.046	▲0.177
2W	▲0.040	▲0.025	▲0.037	▲0.171
3W	-	-	-	▲0.166
1M	-	-	-	▲0.167
2M	-	-	▲0.010	-
3M	-	-	-	▲0.157
6M	-	-	-	▲0.152
1Y	-	-	-	▲0.163

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

本日の市況

本日の無担保コールON物は、▲0.085%の合出から始まった。
 その後は主に▲0.086%~▲0.055%で取引される軟調な地合いとなった。
 調達一巡後も地合いは変わらず、そのまま引けた。

O/N業態別出合レンジ

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲ 0.086 ~ ▲ 0.085	▲ 0.086 ~ ▲ 0.085	▲ 0.086 ~ ▲ 0.040

明日のマーケット

明日も軟調な地合いが継続する見込み。
 主に▲0.086%~▲0.055%で取引されると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報 5月30日	日銀予想 5月31日	当社需給予想 6月1日
券	+100	▲500	+0
財政	▲5,400	+200	▲34,000
過不足	▲5,300	▲300	▲34,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+7,500
CP等買入	▲200	▲1,100	+2,000
社債等買入	▲100	▲100	
ETF買入			+300
国債補完供給	+100	▲200	+200
当座預金増減	▲5,700	+8,500	▲34,000
当座預金残高	3,836,100	3,844,600	3,810,600
準備預金残高	3,351,800		
積み終了先	3,351,000		
超過準備	3,351,000		
非準備先残高	484,300		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	48.4%		
乖離率	51.5%		

5月30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(5/31~)						
5~10年	4,500	15,183	4,508	▲0.008	▲0.007	51.2
10~25年	1,900	3,548	1,906	▲0.009	▲0.008	98.9
25年~	700	2,618	713	▲0.018	▲0.018	62.2

米ドル資金供給(6/1~6/7)

2,200 2,200

国債補完供給(5/30~5/31)

41,762 158 158 ▲0.600 ▲0.600

マネタリーベース [億円]

5月29日時点 4,925,900

所要 [億円]

今積期の所要準備額 3,128,800

5月31日以降の残り所要

積数 3,300

平均 200

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

6月1日	3ヶ月	第761回
6月7日	6ヶ月	
6月8日	3ヶ月	
6月14日	3ヶ月	

国債入札予定

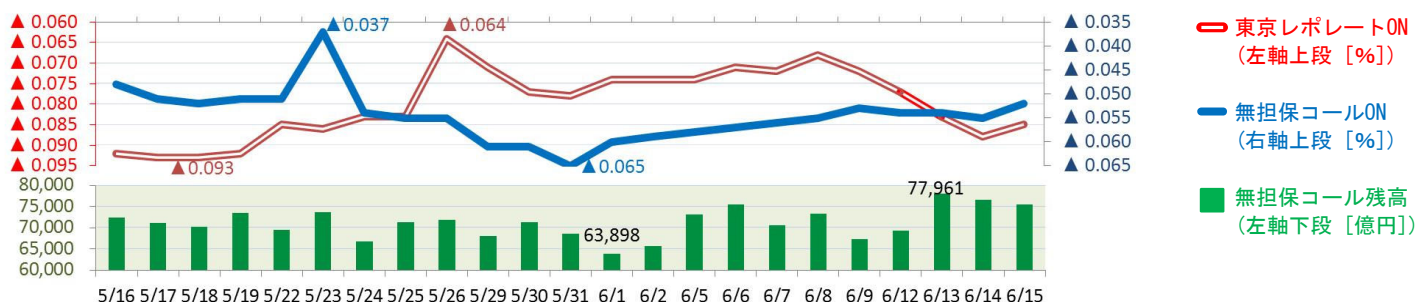
5月31日	2年
6月5日	10年
6月19日	30年
6月21日	5年

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	100~1,000 程度	500	月2回程度	5月16日	0
1年超3年以下	2,000~3,000 程度	2,500	7 9 14 18 23 25	5月25日	0
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,300	1 9 14 18 25 30	5月30日	0
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,500	7 11 16 23 30	5月30日	0
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,900		5月25日	0
25年超	500~1,500 程度	700		4月18日	-
物価連動債	250 程度	250	月2回程度		
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000			

1年前の市場推移

○2017年5月積み期 [5月16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。