

短期市場の推移

[億円][%]

	5月21日	5月22日	5月23日	5月24日
加重平均金利	▲0.068	▲0.068	▲0.070	▲0.070
東京レポレート(ON)	▲0.101	▲0.101	▲0.103	▲0.102
無コール残	69,554	67,392	66,862	66,199
ON	42,744	41,432	40,842	40,059
その他	26,810	25,960	26,020	26,140
有コール残	22,372	20,588	20,364	22,101

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。

5月28日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	企業向けサービス 価格指数(4月)	-	米国休日 (メモリアルデー)	-
	-	-	-	-
	-	-	-	-

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	▲0.071	▲0.128
T/N	-	-	0.000	▲0.150
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	0.001	▲0.033	▲0.150
2W	▲0.030	0.020	▲0.009	▲0.149
3W	-	-	-	▲0.150
1M	▲0.050	0.040	▲0.029	▲0.154
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.153
6M	-	-	-	▲0.150
1Y	-	-	-	▲0.162

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

3日積みとなる本日の無担保コールON物は、▲0.085%の出合から始まった。その後は主に▲0.086%~▲0.055%の水準で取引される軟調な地合となった。同加重平均金利は前日対比▲0.001%の▲0.071%だった。

O/N業態別出合レンジ

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲ 0.086 ~ ▲ 0.086	▲ 0.086 ~ ▲ 0.085	▲ 0.086 ~ ▲ 0.045

明日のマーケット

週明け28日も、本日同様軟調な地合が継続する見込み。
主に▲0.086%~▲0.055%で取引されると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月25日	5月28日	5月28日	5月29日	5月29日	5月29日
券		▲600		+200		+0
財政		▲4,600		▲400		▲1,000
過不足		▲5,200		▲200		▲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
国債買入				+10,700		
共通担保(全店)			▲2,000	+1,600		
CP等買入	▲200		▲500			
社債等買入	▲200			+1,000		
ETF買入		+400				
国債補完供給	+300	▲300	+300			
当座預金増減		▲5,200		+10,900		▲1,000
当座預金残高		3,827,300		3,838,200		3,837,200
準備預金残高		3,348,700				
積み終了先		3,347,700				
超過準備		3,346,900				
非準備先残高		478,600				
準備預金進捗率		99.8%				
平均		38.7%				
乖離率		61.1%				

5月25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(5/28~)						
1~3年	2,500	11,206	2,505	0.005	0.005	72.6
3~5年	3,300	11,162	3,302	0.002	0.002	69.7
5~10年	4,500	15,045	4,506	0.002	0.003	37.1
物価連動	250	1,558	253	▲0.160	▲0.182	26.4
国債補完供給(5/25~5/28)						
	128,942	227	227	▲0.600	▲0.600	
	34,683	51	51	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(5/28~6/11)						
	8,000	1,571	1,571			

マネタリーベース [億円]

所要 [億円]

5月24日時点	4,915,900	今積期の所要準備額	3,128,500
		5月28日以降の残り所要積数	5,200
		平均	300

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

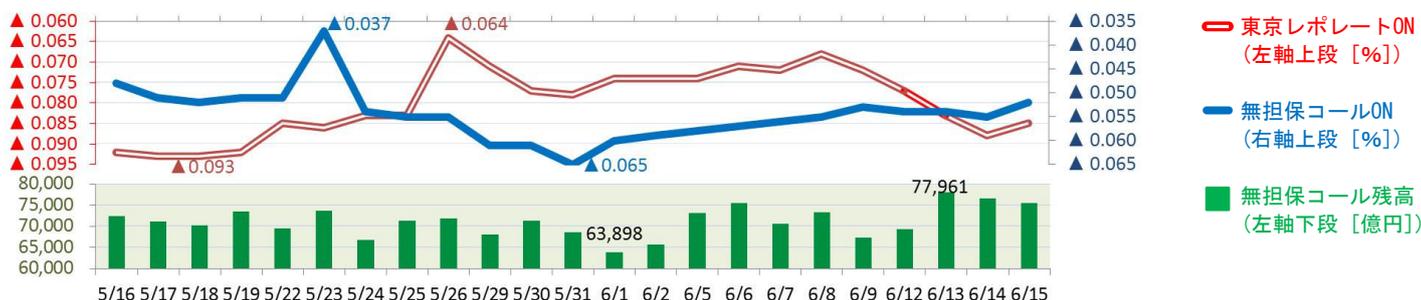
6月1日	3ヶ月	第761回
6月7日	6ヶ月	
6月8日	3ヶ月	
6月14日	3ヶ月	
5月29日	40年	
5月31日	2年	
6月5日	10年	
6月19日	30年	

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

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。