

短期市場の推移 [億円][%]

	5月22日	5月23日	5月24日	5月25日
加重平均金利	▲0.068	▲0.070	▲0.070	▲0.071
東京レポレート(ON)	▲0.101	▲0.103	▲0.102	▲0.128
無コール残	67,392	66,862	66,199	68,024
ON	41,432	40,842	40,059	41,774
その他	25,960	26,020	26,140	26,250
有コール残	20,588	20,364	22,101	18,136

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29日の予定(時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想	
8:30	4月失業率	+2.5%	23:00	(米)5月消費者信頼感指数	127.9
8:30	4月有効求人倍率	1.6倍		-	
	-			-	

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	▲0.069	▲0.110
T/N	-	-	0.000	▲0.152
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.055	▲0.045	▲0.049	▲0.155
2W	▲0.050	0.000	▲0.017	▲0.154
3W	-	-	-	▲0.154
1M	-	-	-	▲0.158
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.155
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

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。

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 ~ ▲ 0.040

明日のマーケット

明日も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する。

資金需給 [億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月28日	5月29日	5月29日	5月30日	5月30日	5月31日
券		+0		▲200		+0
財政		+200		+2,900		▲3,000
過不足		+200		+2,700		▲3,000
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		
国債買入		+10,700				
共通担保(全店)	▲2,000	+1,600				
CP等買入	▲500		▲300			
社債等買入		+1,000				
国債補完供給	+300	▲100	+100			
当座預金増減		+11,200		+7,500		▲3,000
当座預金残高		3,838,500		3,846,000		3,843,000
準備預金残高		3,357,000				
積み終了先		3,356,400				
超過準備		3,356,400				
非準備預金残高		481,500				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		41.9%				
乖離率		57.9%				

5月28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
国庫短期証券買入(5/29~)	5,000	18,578	5,003	▲0.002	▲0.001	83.7
CP等買入(5/31~)	2,000	5,320	1,992	▲0.004	0.002	54.3
国債補完供給(5/28~5/29)						
	58,500	115	115	▲0.600	▲0.600	
	14,190	3	3	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]

5月25日時点 4,911,200

所要 [億円]

今積期の所要準備額 3,128,500
 5月29日以降の残り所要積数 4,600
 平均 300

国庫短期証券入札予定

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	

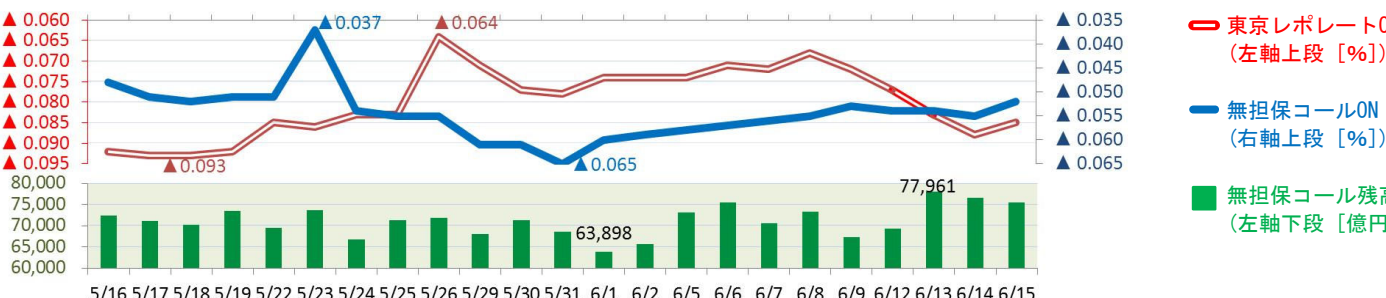
今月の国債買入オペ予定

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	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	7 11 16 23 30	5月23日	1
25年超	500~1,500 程度	700			
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。