

短期市場の推移 [億円] [%]

	5月23日	5月24日	5月25日	5月28日
加重平均金利	▲0.070	▲0.070	▲0.071	▲0.069
東京レポレート(ON)	▲0.103	▲0.102	▲0.128	▲0.110
無コール残	66,862	66,199	68,024	58,424
ON	40,842	40,059	41,774	32,504
その他	26,020	26,140	26,250	25,920
有コール残	20,364	22,101	18,136	24,616

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30日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
9:00	【挨拶】黒田総裁 (国際コンファランス)	20:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]
14:00	5月の消費動向調査 (内閣府)	21:15	(米)5月ADP全米雇用報告
			ペーゾブック

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	▲0.115
T/N	-	-	0.000	▲0.156
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	0.030	▲0.011	▲0.160
2W	-	-	▲0.050	▲0.160
3W	-	-	-	▲0.160
1M	-	-	0.001	▲0.162
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.156
6M	-	-	-	▲0.151
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%の水準で取引される軟調な地合となった。調達一巡後も地合は変わらず、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 ~ ▲ 0.080	▲ 0.085 ~ ▲ 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29日	5月30日	5月30日	5月31日	5月31日	5月31日
券		▲300		+100		▲400
財政		▲1,100		▲8,100		+1,000
過不足		▲1,400		▲8,000		+600
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				
CP等買入	▲300		▲200			
社債等買入			▲100			+2,000
国債補完供給	+100	▲100	+100			
当座預金増減		+3,300		▲8,200		+2,600
当座預金残高		3,841,800		3,833,600		3,836,200
準備預金残高		3,360,400				
積み終了先		3,359,900				
超過準備		3,359,900				
非準備先残高		481,400				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		45.2%				
乖離率		54.7%				

5月29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
国債補完供給(5/29~5/30)						
	40,000	104	104	▲0.600	▲0.600	
	24.087	15	15	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]

5月28日時点 4,922,400

所要 [億円]

今積期の所要準備額	3,128,500
5月30日以降の残り所要積数	4,100
平均	200

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	

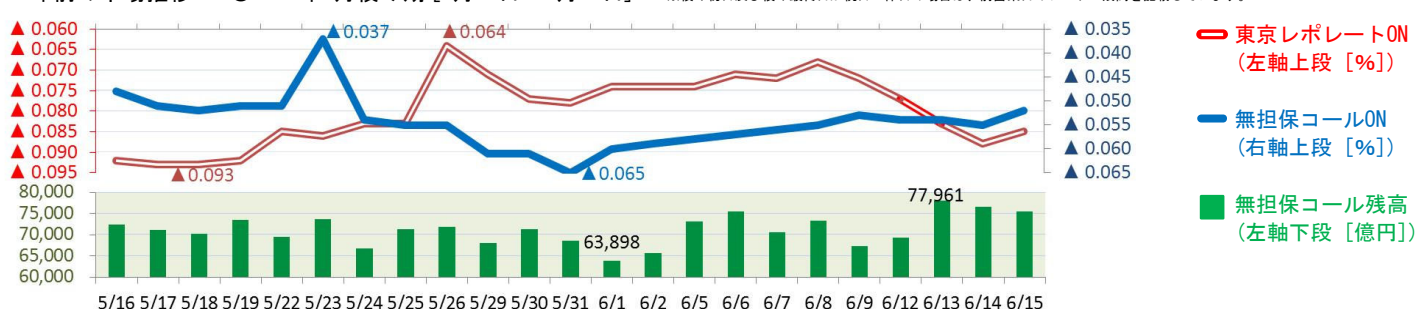
今月の国債買入オペ予定

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			
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。 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