

短期市場の推移

[億円] [%]

	5月27日	5月28日	5月29日	5月30日
加重平均金利	▲0.041	▲0.042	▲0.044	▲0.051
東京レポレート(ON)	▲0.081	▲0.090	▲0.099	▲0.091
無コール残	86,021	84,089	83,746	86,302
ON	53,656	51,604	51,061	54,687
その他	32,365	32,485	32,685	31,615
有コール残	19,151	20,166	19,622	18,971

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。

6月3日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
13:00	日銀当座預金増減要因と金融調節(5月実績)	-	23:00	(米)5月ISM製造業景況指数	53.9

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
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.086	0.001	▲0.058	▲0.082
T/N	-	-	▲0.035	▲0.083
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	0.000	▲0.042	▲0.085
2W	▲0.058	▲0.045	▲0.048	▲0.088
3W	-	-	-	▲0.103
1M	-	-	-	▲0.118
2M	-	-	0.001	-
3M	-	-	-	▲0.128
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.157

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、▲0.065%の合出から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.04%の水準で取引された。同加重平均金利は前営業日対比▲0.008%の▲0.059%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.070		▲0.055 ~ ▲0.050	▲0.070 ~ ▲0.045

翌営業日のマーケット

月末に調達を控えていた先が戻ってくることで本日と比べ出合水準は若干上昇すると予想される。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	5月31日	6月3日	6月3日	6月4日	6月4日	6月4日
券		+400		+1,400		+1,000
財政		▲200		▲38,000		▲56,000
過不足		+200		▲36,600		▲55,000
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				+7,500		
共通担保(全店)				▲600		+700
CP等買入	▲1,100	+2,000	▲100			
社債等買入	▲100					
ETF買入				+300		
国債補完供給		▲200	+200			
成長基盤強化支援						▲6,700 +4,300
当座預金増減		+800		▲28,600		▲57,400
当座預金残高		3,999,000		3,970,400		3,913,000
準備預金残高		3,490,500				
積み終了先		3,490,300				
超過準備		3,490,100				
非準備先残高		508,500				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		58.1%				
乖離率		41.8%				

5月31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	接分
国債買入(6/3~)						
5~10年	4,800	7,667	4,803	▲0.014	▲0.011	54.0
10~25年	1,600	4,180	1,606	▲0.011	▲0.010	70.5
25年~	400	1,487	405	▲0.012	▲0.012	73.7
国債補完供給(5/31~6/3)						
10,000	202	202	▲0.600	▲0.600		
共通担保(全店)(6/3~6/14)						
15,000	673	673				

マナタリーベース [億円]
5月30日時点 5,117,900

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,195,000
6月3日以降の残り所要積数 2,300
平均 200

国庫短期証券入札予定

来月の国債買入オペ予定

6月6日	6ヶ月	第836回
6月7日	3ヶ月	第837回
6月14日	3ヶ月	
6月19日	1年	
国債入札予定		
6月4日	10年	
6月13日	30年	
6月18日	5年	
6月25日	20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27日	2
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	3 10 21 26	5月27日	4
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	7 14 21 28	5月31日	4
10年超25年以下	1,000~3,000 程度	1,600			
25年超	100~1,000 程度	400	7 19 28	5月31日	4
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	5月21日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	4月10日	1

1年前の市場推移 ○2018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。