

短期市場の推移

[億円] [%]

	5月28日	5月29日	5月30日	5月31日
加重平均金利	▲0.042	▲0.044	▲0.051	▲0.059
東京レポレート(ON)	▲0.090	▲0.099	▲0.091	▲0.082
無コール残	84,089	83,746	86,302	80,506
ON	51,604	51,061	54,687	49,601
その他	32,485	32,685	31,615	30,905
有コール残	20,166	19,622	18,971	21,980

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。

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	▲0.085	0.001	▲0.060	▲0.088
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.045	▲0.088
2W	-	-	-	▲0.092
3W	-	-	0.000	▲0.106
1M	-	-	▲0.025	▲0.120
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.130
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

6月4日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネタリーベース(5月)	-	18:00	(欧)4月失業率 7.7%
10:00	営業毎旬報告(5月31日現在)	-	18:00	(欧)5月消費者物価コア指数[前年比] 1.1%
17:00頃	日本銀行が保有する国債の銘柄別残高	-	(米)パウエルFRB議長の挨拶	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は、▲0.070%の合出から始まった。その後は主に▲0.070%~▲0.035%の水準で取引された。同加重平均金利は前営業日対比▲0.001%の▲0.060%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.070		▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.070 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

明日は税揚げ日となるものの、本日と同様の地合いが継続すると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	6月3日	6月4日	6月5日
券	+1,400	+700	+0
財政	▲36,800	▲42,500	▲21,000
過不足	▲35,400	▲41,800	▲21,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+7,500	+8,100	スタート
共通担保(全店)	▲600		
CP等買入	▲100	▲200	
社債等買入		▲100	
ETF買入		+300	
国債補完供給	+200		
成長基盤強化支援		▲6,300	+4,300
			▲100
当座預金増減	▲27,400	▲36,000	▲21,100
当座預金残高	3,971,600	3,935,600	3,914,500
準備預金残高	3,485,800	主な需給要因	
積み終了先	3,485,600		
超過準備	3,485,600	消費税・法人税・保険揚げ	
非準備先残高	485,800	普通交付税	
準備預金進捗率	99.9%	交付金	
平均	61.3%	国債発行(10年)	
乖離率	38.6%		

6月3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(6/4~)						
~1年	500	2,064	500	0.055	0.055	
1~3年	3,500	8,138	3,502	▲0.002	▲0.001	94.9
3~5年	4,000	14,782	4,009	▲0.005	▲0.004	36.9
国債補完供給(6/3~6/4)						
	22,543	2	2	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]
5月31日時点 5,118,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,195,000
6月4日以降の残り所要
積数 2,100
平均 200

国庫短期証券入札予定

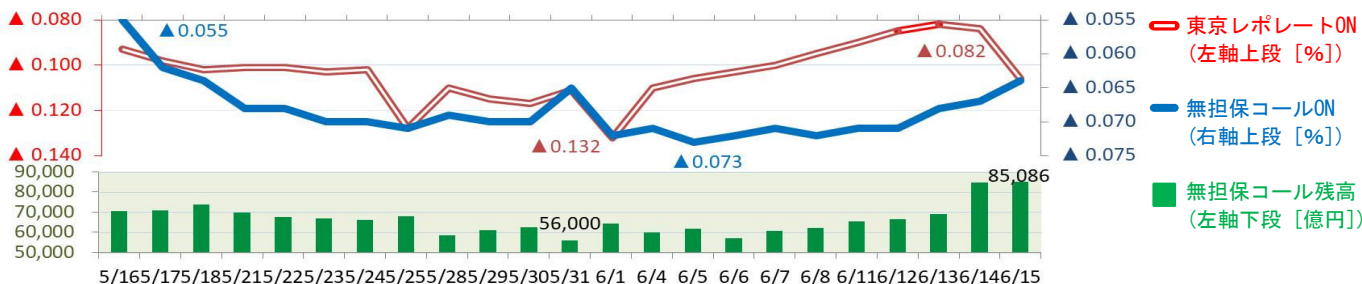
6月6日	6ヶ月	第836回
6月7日	3ヶ月	第837回
6月14日	3ヶ月	
6月19日	1年	
国債入札予定		
6月4日	10年	
6月13日	30年	
6月18日	5年	
6月25日	20年	

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	6月3日	1
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	6月3日	3
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	3
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。

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