

短期市場の推移

[億円] [%]

	5月31日	6月3日	6月4日	6月5日
加重平均金利	▲0.059	▲0.060	▲0.057	▲0.054
東京レポレート(ON)	▲0.082	▲0.088	▲0.086	▲0.086
無コール残	80,506	75,534	79,891	79,638
ON	49,601	46,279	49,716	49,983
その他	30,905	29,255	30,175	29,655
有コール残	21,980	18,982	20,629	20,230

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	▲0.080	0.001	▲0.053	▲0.082
T/N	-	-	-	▲0.090
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.025	▲0.036	▲0.090
2W	-	-	-	▲0.101
3W	-	-	▲0.045	▲0.109
1M	-	-	-	▲0.123
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7日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネタリーベースと日本銀行の取引(5月)	-	21:30 (米)5月非農業部門雇用者数	19.0万人
12:50	【講演】黒田総裁(G20/GPFIフォーラム)	-	21:30 (米)5月失業率	3.6%
15:00	コール市場残高(5月)	-	-	-

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、▲0.055%の合出から始まった。その後は主に▲0.065%～▲0.045%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▲0.053%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.055		▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.070 ~ ▲0.040

翌営業日のマーケット

週末3日積みとなるため調達ニーズがやや強くなり、出会いの水準は小幅上昇と予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	6月6日	6月7日	6月10日
券	▲100	+300	+1,000
財政	+3,100	▲300	▲3,000
過不足	+3,000	+0	▲2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)			▲2,700
CP等買入	▲200	▲400	+2,500
ETF買入	+100	+400	+400
当座預金増減	+2,900	+2,500	▲4,700
当座預金残高	3,920,000	3,922,500	3,917,800
準備預金残高	3,448,700	主な需給要因	
積み終了先	3,448,500		
超過準備	3,448,500		
非準備先残高	471,300		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	71.0%		
乖離率	28.9%		

6月6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(6/6~6/7)	74,917	1	1	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]
6月5日時点 5,033,200

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,195,000
6月7日以降の残り所要	
積数	1,400
平均	200

国庫短期証券入札予定

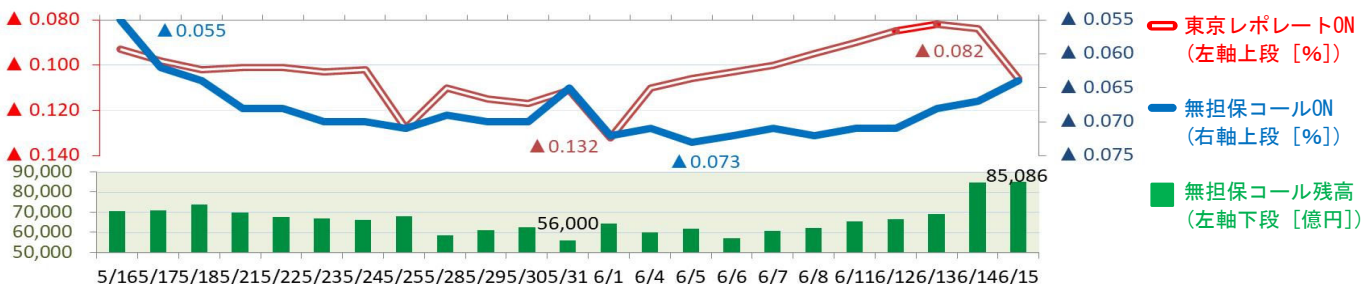
6月7日	3ヶ月	第837/回
6月14日	3ヶ月	
6月19日	1年	
6月21日	3ヶ月	
国債入札予定		
6月13日	30年	
6月18日	5年	
6月25日	20年	
6月27日	2年	

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。