

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	▲0.069	▲0.070	▲0.070	▲0.065
東京レポレート(ON)	▲0.110	▲0.115	▲0.117	▲0.111
無コール残	58,424	61,135	62,356	56,000
ON	32,504	34,645	34,936	30,270
その他	25,920	26,490	27,420	25,730
有コール残	24,616	15,889	16,460	12,231

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月生産者物価指数[前年比]
10:00	営業毎旬報告(5月31日現在)	-		2.4%
17:00頃	日本銀行が保有する国債の銘柄別残高	-		

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	▲0.072	▲0.132
T/N	-	-	0.000	▲0.145
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	0.030	▲0.022	▲0.153
2W	▲0.060	▲0.040	▲0.052	▲0.154
3W	-	-	-	▲0.154
1M	-	-	-	▲0.164
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.158
6M	-	-	-	▲0.152
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%で取引される軟調な地合いであった。本日通知された国債の買入では残存5年超10年以下の買入れ額が前回の4,500億円から4,300億円に減額された。

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	▲ 0.085 ~ ▲ 0.045

明日のマーケット

週明けも軟調な地合いが継続する見込み。
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	
	6月1日		6月4日		6月5日	
券		▲400		+1,000		+1,000
財政		▲33,000		▲53,200		+4,000
過不足		▲33,400		▲52,200		+5,000
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				+5,100		
共通担保(全店)			▲2,000	+2,400		
CP等買入			▲100			
社債等買入	▲100		▲200			
ETF買入				+100		
国債補完供給	+1,100	▲300	+300			
成長基盤強化支援			▲3,700	+5,200	▲300	
当座預金増減		▲32,700		▲45,100		+4,700
当座預金残高		3,809,700		3,764,600		3,769,300
準備預金残高		3,316,800				
積み終了先		3,316,600				
超過準備		3,316,400				
非準備先残高		492,900				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		61.3%				
乖離率		38.6%				

6月1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	3,426	501	0.011	0.013	91.7
5~10年	4,300	16,143	4,303	0.011	0.012	73.9
物価連動	250	1,234	250	▲0.180	▲0.195	45.5
国債補完供給(6/1~6/4)						
	75,317	272	272	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(6/4~6/18)						
	8,000	2,382	2,382			

マネタリーベース [億円]
5月31日時点 4,926,700所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,124,900
6月4日以降の残り所要積数 2,000
平均 200

国庫短期証券入札予定

6月7日	6ヶ月	第762回
6月8日	3ヶ月	第763回
6月14日	3ヶ月	
6月19日	1年	

国債入札予定

6月5日	10年
6月19日	30年
6月21日	5年
6月26日	20年

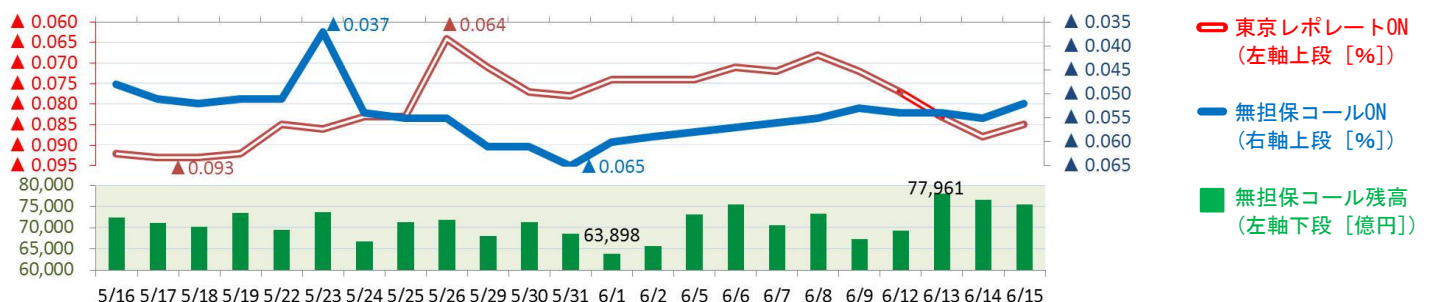
今月の国債買入オペ予定

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1日	1
1年超3年以下	2,000~3,000 程度	2,500			
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,300	4 6 14 22 29	5月25日	6
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,300	6 13 20 22 29	6月1日	5
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,900	4 8 14 20 27	5月30日	5
25年超	500~1,500 程度	700			
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	6月1日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	4月18日	1

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。