

短期市場の推移 [億円][%]

	5月29日	5月30日	5月31日	6月1日
加重平均金利	▲0.070	▲0.070	▲0.065	▲0.072
東京レポレート(ON)	▲0.115	▲0.117	▲0.111	▲0.132
無コール残	61,135	62,356	56,000	64,083
ON	34,645	34,936	30,270	37,603
その他	26,490	27,420	25,730	26,480
有コール残	15,889	16,460	12,231	15,711

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5日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 日銀当座預金増減要因(6月見込み)	-	17:30 (英)5月サービス業購買担当者指数(PMI)	52.5
-	-	23:00 (米)4月JOLT求人件数	-
-	-	23:00 (米)5月ISM非製造業景況指数	58.0

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	▲0.071	▲0.110
T/N	-	-	0.000	▲0.140
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	▲0.040	▲0.056	▲0.150
2W	▲0.060	▲0.032	▲0.049	▲0.151
3W	-	-	-	▲0.153
1M	-	-	0.050	▲0.164
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.157
6M	-	-	-	▲0.153
1Y	-	-	-	▲0.162

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。本日は法人税揚げ、普通交付税交付金払い日であったが、地合いは変わらず、その後は▲0.086%~▲0.055%で取引された。

O/N業態別出合レンジ [%]

都銀・信託	証券	地銀
▲ 0.086 ~ ▲ 0.085	▲ 0.086 ~ ▲ 0.085	▲ 0.086 ~ ▲ 0.045

明日のマーケット

明日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4日	6月5日	6月4日	6月5日	6月6日	6月6日
券		+900		+500		+0
財政		▲55,000		+2,700		▲19,000
過不足		▲54,100		+3,200		▲19,000
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
国庫短期証券買入				+5,000		
国債買入		+5,100		+8,500		
共通担保(全店)	▲2,000	+2,400				
CP等買入	▲100		▲300			
社債等買入	▲200		▲100			
ETF買入		+100		+300		
国債補完供給	+300	▲200	+200			
成長基盤強化支援	▲3,700	+5,200				
当座預金増減		▲47,200		+16,800		▲19,000
当座預金残高		3,762,500		3,779,300		3,760,300
準備預金残高		3,290,700				
積み終了先		3,290,500				
超過準備		3,290,500				
非準備先残高		471,800				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		64.5%				
乖離率		35.4%				

6月4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
国庫短期証券買入(6/5~)	5,000	23,365	5,001	0.002	0.003	60.5
国債買入(6/5~)						
1~3年	2,500	12,733	2,502	0.006	0.007	51.5
3~5年	3,300	11,749	3,304	0.006	0.006	93.0
10~25年	1,900	6,533	1,913	0.007	0.008	15.2
25年~	700	2,240	706	0.008	0.009	55.2
国債補完供給(6/4~6/5)						
87,710	160	160	▲0.600	▲0.600		
19,578	5	5	▲0.600	▲0.600		

マネタリーベース [億円]

6月1日時点 4,894,500

所要 [億円]

今積期の所要準備額 3,124,900
6月5日以降の残り所要積数 1,800
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	

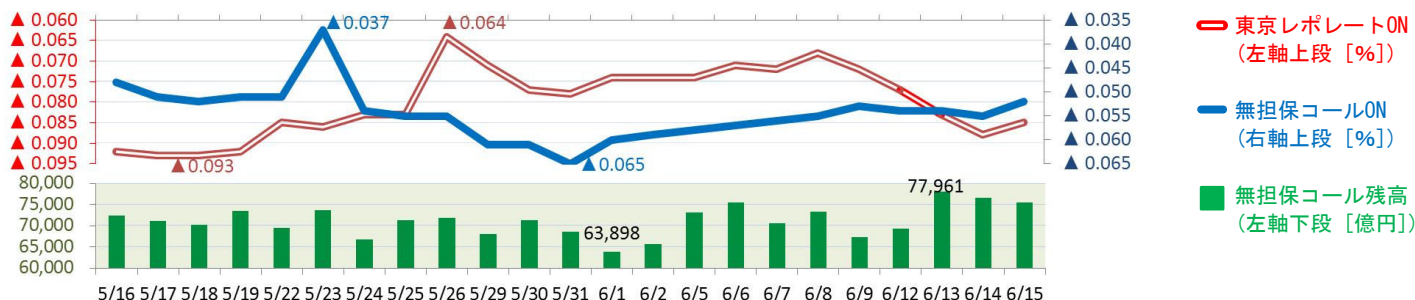
今月の国債買入オペ予定

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	4	6 14 22 27 29	6月4日	5
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,300	4	6 13 20 22 29	6月1日	5
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,300	4	6 14 20 27	6月4日	4
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,900	4	8 14 20 27	6月1日	1
25年超	500~1,500 程度	700	1回		4月18日	1
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。