

短期市場の推移

[億円][%]

	5月30日	5月31日	6月1日	6月4日
加重平均金利	▲0.070	▲0.065	▲0.072	▲0.071
東京レポレート(ON)	▲0.117	▲0.111	▲0.132	▲0.110
無コール残	62,356	56,000	64,083	60,070
ON	34,936	30,270	37,603	33,490
その他	27,420	25,730	26,480	26,580
有コール残	16,460	12,231	15,711	17,166

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6日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-		20:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]
-		21:30	(米)4月貿易収支
-		-	-513億米ドル

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	▲0.073	▲0.106
T/N	-	-	0.000	▲0.117
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.065	0.000	▲0.049	▲0.139
2W	▲0.065	▲0.055	▲0.058	▲0.142
3W	0.001	0.035	0.024	▲0.144
1M	-	-	-	▲0.158
2M	-	-	-	-
3M	▲0.027	0.001	▲0.023	▲0.155
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。
その後は▲0.086%~▲0.055%で取引される軟調な地合となった。
調達一巡後も地合は変わらず、そのまま引けた。

O/N業態別合出レンジ

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲ 0.086 ~ ▲ 0.086	▲ 0.086 ~ ▲ 0.085	▲ 0.086 ~ ▲ 0.055

明日のマーケット

明日も軟調な地合が継続する見込み。
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5日	6月6日	6月7日
券	+600	+600	+0
財政	+600	▲18,700	+4,000
過不足	+1,200	▲18,100	+4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+5,000		
国債買入	+8,500		
CP等買入	▲300	▲300	
社債等買入	▲100	▲200	
ETF買入	+300		
国債補完供給	+200	+400	
当座預金増減	+14,400	▲18,200	+4,000
当座預金残高	3,776,900	3,758,700	3,762,700
準備預金残高	3,312,600	主な需給要因	
積み終了先	3,312,500		
超過準備	3,312,500		
非準備先残高	464,300		
準備預金進捗率	99.9%	国債発行(10年)	
平均	67.7%		
乖離率	32.2%		

6月5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
米ドル資金供給(6/7~6/14)		1	1	2,200	2,200	
CP等買入(6/8~)	2,500	6,972	2,487	▲0.005	▲0.003	34.1
国債補完供給(6/5~6/6)	64,544	355	355	▲0.600	▲0.600	
	14,650	1	1	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]

6月4日時点 4,846,400

所要

[億円]

今積期の所要準備額	3,124,900
6月6日以降の残り所要	
積数	1,600
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19日	30年
6月21日	5年
6月26日	20年
6月28日	2年

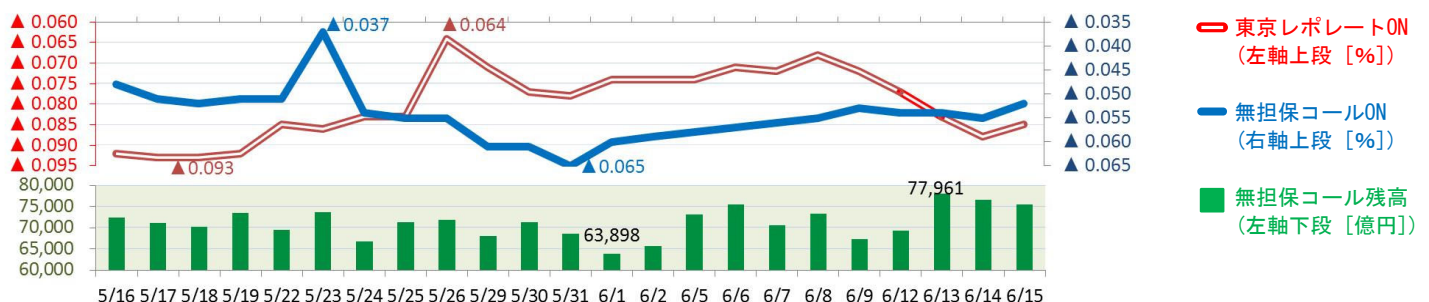
今月の国債買入オペ予定

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

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。