

短期市場の推移 [億円][%]

| | 5月31日 | 6月1日 | 6月4日 | 6月5日 |
|-------------|--------|--------|--------|--------|
| 加重平均金利 | ▲0.065 | ▲0.072 | ▲0.071 | ▲0.073 |
| 東京レポレート(ON) | ▲0.111 | ▲0.132 | ▲0.110 | ▲0.106 |
| 無コール残 | 56,000 | 64,083 | 60,070 | 61,876 |
| ON | 30,270 | 37,603 | 33,490 | 33,796 |
| その他 | 25,730 | 26,480 | 26,580 | 28,080 |
| 有コール残 | 12,231 | 15,711 | 17,166 | 19,047 |

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7日の予定 (時刻は日本時間)

| 日本 | 予想 | 海外 | 予想 |
|----|----|--------------------------|----|
| - | - | (米)日米首脳会談 | - |
| - | - | 21:30 (米)新規失業保険申請件数[前週分] | - |
| - | - | - | - |

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 | ▲0.072 | ▲0.103 |
| T/N | - | - | 0.000 | ▲0.113 |
| S/N | - | - | - | - |
| 1W | ▲0.065 | ▲0.030 | ▲0.051 | ▲0.130 |
| 2W | - | - | 0.000 | ▲0.133 |
| 3W | - | - | 0.030 | ▲0.135 |
| 1M | - | - | - | ▲0.153 |
| 2M | - | - | - | - |
| 3M | - | - | - | ▲0.151 |
| 6M | - | - | - | ▲0.152 |
| 1Y | - | - | - | ▲0.161 |

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%~▲0.060%で取引される軟調な地合となった。加重平均金利は前日とほぼ横ばいの▲0.072%(速報)となった。

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 | ▲ 0.086 ~ ▲ 0.060 |

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%~▲0.060%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6日 | 6月7日 | 6月7日 | 6月8日 | 6月8日 | 6月8日 |
| 券 | | +600 | | ▲300 | | +0 |
| 財政 | | ▲17,900 | | +6,000 | | ▲5,000 |
| 過不足 | | ▲17,300 | | +5,700 | | ▲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 | | | | +10,300 | | |
| CP等買入 | ▲300 | | ▲100 | | | +2,500 |
| 社債等買入 | ▲200 | | | | | |
| 国債補充供給 | +400 | ▲100 | +100 | | | |
| 当座預金増減 | | ▲17,500 | | +16,000 | | ▲2,500 |
| 当座預金残高 | | 3,759,400 | | 3,775,400 | | 3,772,900 |
| 準備預金残高 | | 3,298,400 | | | | |
| 積み終了先 | | 3,298,200 | | | | |
| 超過準備 | | 3,298,200 | | | | |
| 非準備先残高 | | 461,000 | | | | |
| 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 |
|-----------------|--------|--------|-------|--------|--------|------|
| 国債買入(6/7~) | | | | | | |
| 1~3年 | 2,500 | 9,093 | 2,505 | 0.001 | 0.002 | 60.4 |
| 3~5年 | 3,300 | 9,618 | 3,305 | ▲0.005 | ▲0.004 | 39.7 |
| 5~10年 | 4,300 | 18,301 | 4,312 | ▲0.003 | ▲0.002 | 17.3 |
| 国債補充供給(6/6~6/7) | | | | | | |
| | 44,547 | 48 | 48 | ▲0.600 | ▲0.600 | |

マネタリーベース [億円]
6月5日時点 4,860,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,124,900
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 | 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 | |
| 6月19日 | 30年 | |
| 6月21日 | 5年 | |
| 6月26日 | 20年 | |
| 6月28日 | 2年 | |

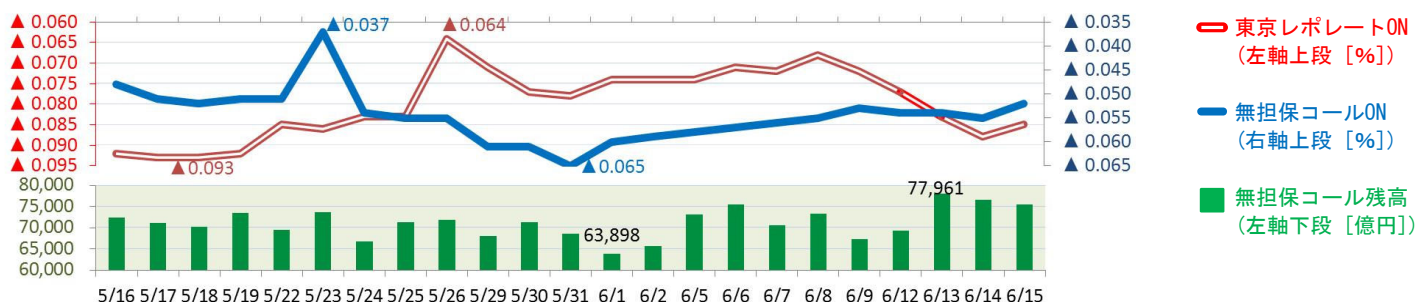
今月の国債買入オペ予定

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