



## Kaede Market Report

## 金利情報

| LIBOR | JPY      |         | USD     |          | EUR      |         | GBP     |          |
|-------|----------|---------|---------|----------|----------|---------|---------|----------|
|       | 前日比      | 前日比     | 前日比     | 前日比      | 前日比      | 前日比     | 前日比     |          |
| O/N   | -0.02671 | 0.01772 | 0.69278 | -0.00055 | -0.41071 | 0       | 0.225   | -0.00125 |
| 1W    | -0.01543 | 0.03957 | 0.71733 | -0.00223 | -0.39829 | 0       | 0.23656 | -0.00375 |
| 1M    | -0.04157 | 0.00929 | 0.76722 | 0.00222  | -0.38071 | 0       | 0.26156 | 0.00062  |
| 2M    | -0.01671 | 0.01    | 0.83333 | 0.00166  | -0.35886 | 0       | 0.319   | 0.00062  |
| 3M    | -0.027   | 0.00143 | 1.02178 | 0.00389  | -0.34071 | 0       | 0.36013 | -0.00125 |
| 6M    | 0.01743  | 0.00143 | 1.33461 | 0.00083  | -0.237   | 0       | 0.53025 | -0.00313 |
| 1Y    | 0.13014  | 0.00143 | 1.70289 | 0.00111  | -0.09329 | 0.00085 | 0.77913 | -0.0025  |

| TIBOR | ACT/365 |     |
|-------|---------|-----|
|       | 前日比     | 前日比 |
| O/N   | -       | -   |
| 1W    | 0.00909 | 0   |
| 1M    | 0.03    | 0   |
| 2M    | 0.04636 | 0   |
| 3M    | 0.05727 | 0   |
| 6M    | 0.10636 | 0   |
| 1Y    | 0.12818 | 0   |

## Swap Rate

| Swap Rate | JPY     |          | USD     |         | EUR    |         | GBP    |         |
|-----------|---------|----------|---------|---------|--------|---------|--------|---------|
|           | 前日比     | 前日比      | 前日比     | 前日比     | 前日比    | 前日比     | 前日比    |         |
| 1Y        | 0.01996 | -0.00129 | 1.224   | 0.0059  | -0.225 | -0.006  | 0.551  | -0.003  |
| 18M       | 0.02125 | -0.00125 | 1.35175 | 0.00555 | -0.205 | -0.009  | 0.581  | -0.003  |
| 2Y        | 0.0225  | -0.0025  | 1.4795  | 0.0052  | -0.184 | -0.015  | 0.6165 | -0.005  |
| 3Y        | 0.03    | -0.0025  | 1.6773  | 0.005   | -0.113 | -0.014  | 0.704  | -0.0105 |
| 4Y        | 0.0475  | -0.0025  | 1.8214  | 0.0073  | -0.018 | -0.0167 | 0.8035 | -0.011  |
| 5Y        | 0.07    | -0.0025  | 1.9313  | 0.0132  | 0.084  | -0.0178 | 0.9025 | -0.013  |
| 7Y        | 0.125   | -0.0025  | 2.0923  | 0.0039  | 0.323  | -0.026  | 1.088  | -0.017  |
| 10Y       | 0.2275  | -0.00125 | 2.2506  | -0.0006 | 0.6745 | -0.033  | 1.3266 | 0.0026  |
| 12Y       | 0.31125 | 0        | 2.3255  | -0.0027 | 0.8565 | -0.035  | 1.4055 | -0.02   |
| 15Y       | 0.4575  | 0        | 2.3948  | -0.0054 | 1.046  | -0.0365 | 1.4985 | -0.019  |
| 20Y       | 0.6625  | 0.0025   | 2.453   | -0.0071 | 1.2    | -0.0355 | 1.5475 | -0.0185 |
| 30Y       | 0.8275  | 0.00125  | 2.474   | -0.0081 | 1.267  | -0.0365 | 1.518  | -0.0175 |

| 無担コールO/N | ACT/365  |         |
|----------|----------|---------|
|          | 前日比      | 前日比     |
| Bid      | -0.03665 | 0.00639 |
| Ask      | -0.03665 | 0.00639 |

| プライムレート | ACT/365 |     |
|---------|---------|-----|
|         | 前日比     | 前日比 |
| 短ブラ     | 1.475   | 0   |
| 長ブラ     | 0.95    | 0   |

| 国債先物  | ACT/365 |      |
|-------|---------|------|
|       | 前日比     | 前日比  |
| 10年先物 | 150.26  | 0.06 |

## 格付利回り情報：日本証券業協会

| R&I | R&I   |      |      |      |      |
|-----|-------|------|------|------|------|
|     | AAA   | AA   | A    | BBB  | BB   |
| 1Y  | -0.01 | 0.03 | 0.17 | 0.17 | 5.96 |
| 2Y  | 0.04  | 0.09 | 0.29 | 0.29 | 1.54 |
| 3Y  | 0.07  | 0.16 | 0.51 | 0.51 | 3.56 |
| 4Y  | 0.09  | 0.21 | 0.60 | 0.60 | 1.62 |
| 5Y  | 0.14  | 0.28 | 0.56 | 0.56 |      |
| 6Y  | 0.19  | 0.32 | 0.70 | 0.70 |      |
| 7Y  | 0.21  | 0.43 | 0.75 | 0.75 |      |
| 8Y  | 0.25  | 0.48 |      |      |      |
| 9Y  | 0.27  | 0.48 | 0.74 | 0.74 |      |
| 10Y | 0.38  | 0.51 |      |      |      |
| 15Y | 0.64  | 0.82 | #N/A | #N/A | Sec  |
| 20Y | 1.06  | 1.32 | 1.71 | #N/A | Sec  |

| JCR | JCR   |      |      |      |      |
|-----|-------|------|------|------|------|
|     | AAA   | AA   | A    | BBB  | BB   |
| 1Y  | -0.02 | 0.02 | 0.08 | 0.30 | 0.30 |
| 2Y  | 0.05  | 0.06 | 0.19 | 0.33 | 0.33 |
| 3Y  | 0.03  | 0.13 | 0.25 | 0.39 | 0.39 |
| 4Y  | 0.06  | 0.16 | 0.29 | 0.65 | 0.65 |
| 5Y  | 0.12  | 0.22 | 0.43 | 1.02 | 1.02 |
| 6Y  | 0.16  | 0.26 | 0.43 | 0.77 | 0.77 |
| 7Y  | 0.19  | 0.37 | 0.53 | 0.78 | #N/A |
| 8Y  | 0.19  | 0.42 | 0.59 | #N/A | Sec  |
| 9Y  | 0.24  | 0.45 | 0.62 | 0.74 | #N/A |
| 10Y | 0.36  | 0.49 | 0.58 | #N/A | Sec  |
| 15Y | 0.60  | 0.82 | #N/A | #N/A | Sec  |
| 20Y | 1.06  | 1.34 | 1.71 | #N/A | Sec  |

## 為替情報

|     | USD    | EUR    | JPY  | GBP    | CHF    | CAD   | AUD   | NZD   | HKD   | NOK   | SEK   |
|-----|--------|--------|------|--------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| SEK | 9.03   | 9.55   | 7.82 | 11.02  | 8.90   | 6.85  | 6.72  | 6.37  | 1.16  | 1.06  | 1.00  |
| NOK | 8.55   | 9.05   | 7.41 | 10.44  | 8.43   | 6.49  | 6.36  | 6.03  | 1.10  | 1.00  | 0.95  |
| HKD | 7.75   | 8.21   | 6.72 | 9.47   | 7.65   | 5.88  | 5.77  | 5.47  | 1.00  | 0.91  | 0.86  |
| NZD | 1.42   | 1.50   | 0.01 | 1.73   | 1.40   | 1.08  | 1.05  | 1.00  | 0.18  | 0.17  | 0.16  |
| AUD | 1.34   | 1.42   | 1.16 | 1.64   | 1.33   | 1.02  | 1.00  | 0.95  | 0.17  | 0.16  | 0.15  |
| CAD | 1.32   | 1.39   | 1.14 | 1.61   | 1.30   | 1.00  | 0.98  | 0.93  | 0.17  | 0.15  | 0.15  |
| CHF | 1.01   | 1.07   | 0.88 | 1.24   | 1.00   | 0.77  | 0.75  | 0.72  | 0.13  | 0.12  | 0.11  |
| GBP | 0.82   | 0.87   | 0.71 | 1.00   | 0.81   | 0.62  | 0.61  | 0.58  | 0.11  | 0.10  | 0.09  |
| JPY | 115.41 | 122.14 | 1.00 | 140.93 | 113.81 | 87.57 | 85.88 | 81.42 | 14.88 | 13.50 | 12.79 |
| EUR | 0.94   | 1.00   | 0.82 | 1.15   | 0.93   | 0.72  | 0.70  | 0.67  | 0.12  | 0.11  | 0.10  |
| USD | 1.00   | 1.06   | 0.87 | 1.22   | 0.99   | 0.76  | 0.74  | 0.71  | 0.13  | 0.12  | 0.11  |

\*100

## 株式情報

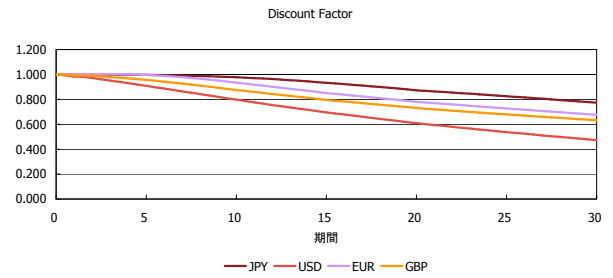
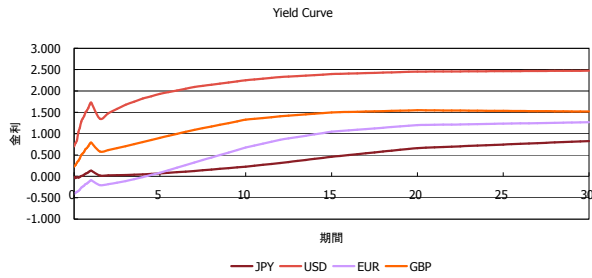
| INDEX | 日経225  |     | TOPIX |     | JASDAQ |     | ダウ     |     | S&P500 |     | FT100 |    |
|-------|--------|-----|-------|-----|--------|-----|--------|-----|--------|-----|-------|----|
|       | 前日比    | 前日比 | 前日比   | 前日比 | 前日比    | 前日比 | 前日比    | 前日比 | 前日比    | 前日比 | 前日比   |    |
| INDEX | 19,365 | -63 | 1,550 | 8   | 2,810  | 2   | 19,954 | 99  | 2,271  | 7   | 7,290 | 15 |

出所：Bloombergよりかえてキャピタルマネジメントにて作成

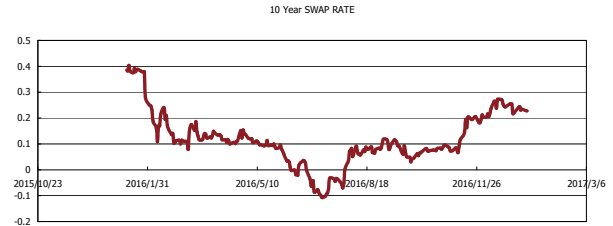
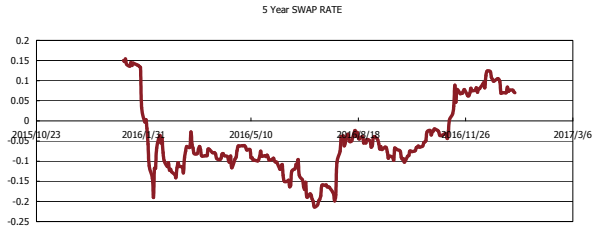
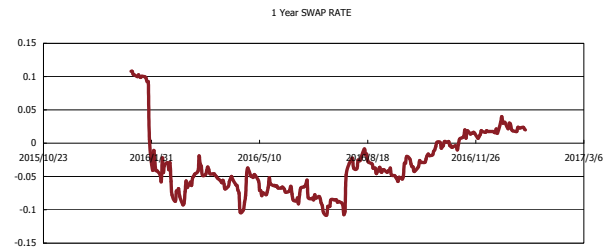
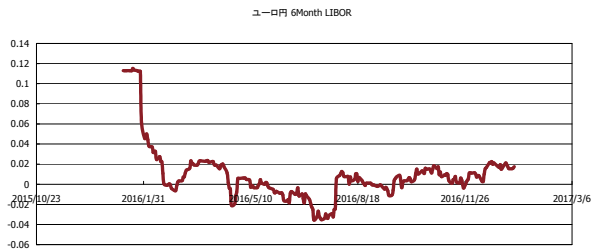


# Kaede Market Report

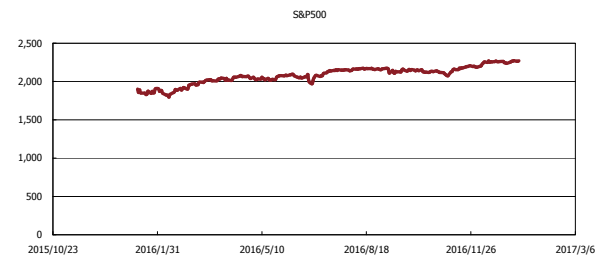
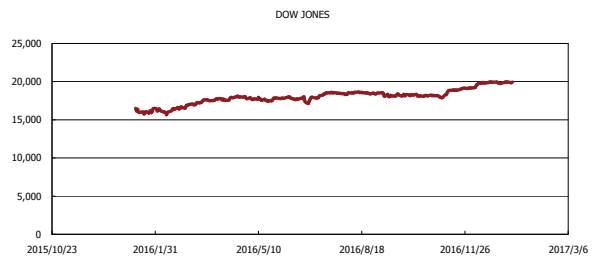
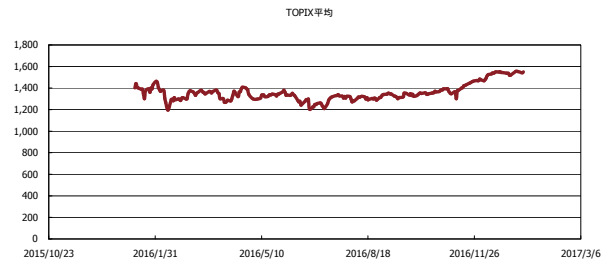
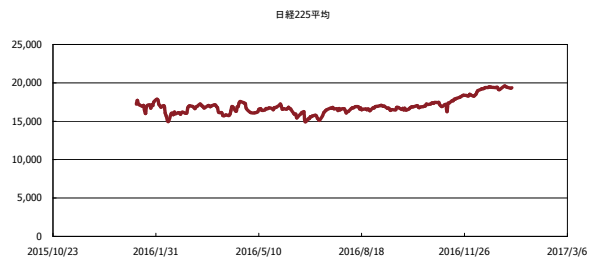
## 金利情報：Yield Curve



## 金利情報：ヒストリカル・データ



## 株価データ：ヒストリカル・データ



出所：Bloombergよりかえてでキャピタルマネジメントにて作成