

短期市場の推移

[億円] [%]

	6月14日	6月15日	6月18日	6月19日
加重平均金利	▲0.067	▲0.064	▲0.069	▲0.070
東京レポレート(ON)	▲0.084	▲0.106	▲0.097	▲0.099
無コール残	84,640	85,086	63,464	65,695
ON	51,140	52,746	34,964	37,265
その他	33,500	32,340	28,500	28,430
有コール残	31,668	24,450	23,014	20,816

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21日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
10:30 【挨拶】布野審議委員(宮城)	-	21:30 (米)新規失業保険申請件数[前週分]	-
-	-	21:30 (米)6月フィラデルフィア連銀製造業景況指数	25.0
-	-	23:00 (米)5月景気先行指数	0.4%

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	▲0.104
T/N	-	-	0.000	▲0.122
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.080	▲0.020	▲0.070	▲0.131
2W	0.010	0.085	0.038	▲0.159
3W	-	-	-	▲0.149
1M	-	-	-	▲0.148
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.144
6M	-	-	-	▲0.150
1Y	-	-	-	▲0.160

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

無担保コールON物は、昨日に引き続きビッドが薄く、▲0.086%~▲0.050%の水準で取引される軟調な地合となった。
同加重平均金利(速報)は、前日比▲0.003%の▲0.073%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	▲0.085 ~ ▲0.085	▲0.086 ~ ▲0.050

明日のマーケット

引き続き資金余剰感が強く、軟調な地合が継続する見込み。
本日と同様に、▲0.086%~▲0.050%の水準で取引されると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月20日	6月21日	6月21日	6月22日	6月22日	6月22日
券		▲900	▲1,700	▲2,000		
財政		+58,000	▲3,900	▲21,000		
過不足		+57,100	▲5,600	▲23,000		
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				+7,300		
CP等買入	▲600		▲100			
社債等買入	▲1,100					
ETF買入				+100		
国債補完供給	+800	▲600	+600			
貸出増加支援	▲19,700	+17,600				
当座預金増減		+53,500	+2,300	▲23,000		
当座預金残高		3,931,500	3,933,800	3,910,800		
準備預金残高		3,449,200	主な需給要因			
積み終了先		3,442,800				
超過準備		3,435,200				
非準備先残高		482,300				
準備預金進捗率		99.3%				
平均		16.7%				
乖離率		82.7%				

6月20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	接分
国債買入(6/21~)						
5~10年	4,300	14,057	4,307	0.007	0.007	79.2
10~25年	1,900	5,937	1,916	0.006	0.007	24.4
25年~	700	2,452	705	0.003	0.004	75.2
国債補完供給(6/20~6/21)						
	1,000	610	610	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]
6月19日時点 4,961,900

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,017,200
6月21日以降の残り所要積数 19,700
平均 800

国庫短期証券入札予定

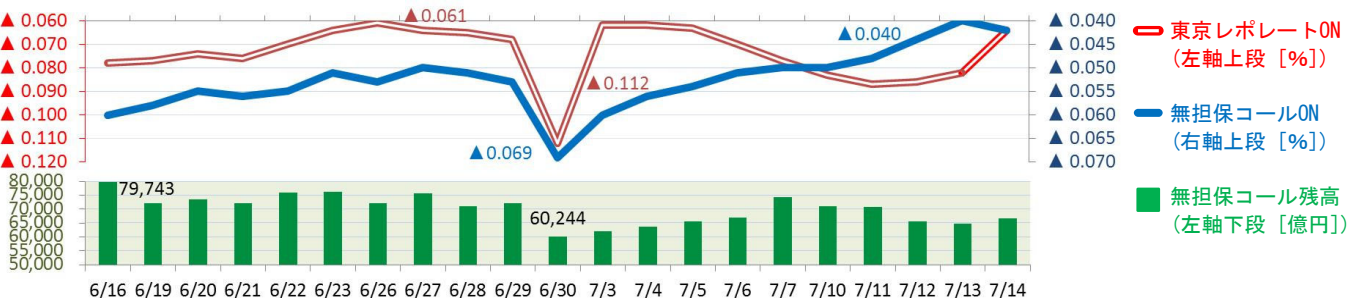
6月22日	3ヶ月	第766回
6月29日	3ヶ月	
7月6日	3ヶ月	
7月9日	6ヶ月	
6月21日	5年	
6月26日	20年	
6月28日	2年	
7月3日	10年	

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	
			月2回程度							
1年以下	100~1,000 程度	500					6月13日	0		
1年超3年以下	2,000~3,000 程度	2,500					6月14日	3		
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,000	4	6	14	22	27	29	6月14日	3
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,300	1	6	13	20	22	29	6月20日	2
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,900							6月20日	1
25年超	500~1,500 程度	700	4	8	14	20	27		6月20日	1
物価連動債	250 程度	250	月2回程度					6月13日	0	
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回					6月8日	0	

1年前の市場推移

○2017年6月積み期 [6月16日~7月14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。