

短期市場の推移

	6月21日	6月22日	6月25日	6月26日
加重平均金利	▲0.072	▲0.075	▲0.073	▲0.074
東京レポレート(ON)	▲0.102	▲0.109	▲0.108	▲0.104
無コール残	67,546	64,836	65,099	66,969
ON	36,016	33,526	33,979	35,964
その他	31,530	31,310	31,120	31,005
有コール残	20,163	17,808	18,214	19,464

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28日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50	製造業部門別投入・産出物価指数(5月)	(欧)EU首脳会議(29日まで)	-
-	-	21:30	(米)1~3月GDP確報値[前期比年率] 2.2%
-	-	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
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.086	0.001	▲0.073	▲0.111
T/N	-	-	0.000	▲0.118
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.065	▲0.146
2W	-	-	▲0.055	▲0.140
3W	-	-	-	▲0.136
1M	-	-	-	▲0.135
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.137
6M	-	-	-	▲0.149
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、▲0.085%の出合から始まった。
 主な出合の水準は▲0.086%~▲0.050%であった。
 同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%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	▲0.086 ~ ▲0.080	▲0.086 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

翌営業日も、本日と同様の地合が継続する見込み。
 ▲0.086%~▲0.050%の水準で取引されると予想。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	6月27日	6月28日	6月29日
券	▲1,000	▲1,800	▲100
財政	▲12,800	+5,300	+400
過不足	▲13,800	+3,500	+300
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	-	+8,700	-
CP等買入	▲300	▲100	+2,500
ETF買入	+100	+400	-
国債補完供給	+300	▲100	+100
当座預金増減	▲13,800	+12,600	+2,800
当座預金残高	3,919,500	3,932,100	3,934,900
準備預金残高	3,424,500	主な需給要因	
積み終了先	3,424,300	-	-
超過準備	3,424,300	-	-
非率預先残高	495,000	-	-
準備預金進捗率	99.9%	-	-
平均	40.0%	-	-
乖離率	59.9%	-	-

6月27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(6/28~)						
1~3年	2,500	13,742	2,513	0.005	0.005	83.3
3~5年	3,000	11,717	3,011	▲0.002	▲0.001	12.5
10~25年	1,900	6,006	1,922	▲0.003	▲0.002	64.9
25年~	700	2,483	707	▲0.002	▲0.002	58.9
国債補完供給(6/27~6/28)						
7.617	5	5	▲0.600	▲0.600		
8.282	112	112	▲0.600	▲0.600		

マナタリーベース [億円]
 6月26日時点 5,022,800

所要 [億円]
 今積期の所要準備額 3,017,200
 6月28日以降の残り所要積数 3,600
 平均 200

国庫短期証券入札予定

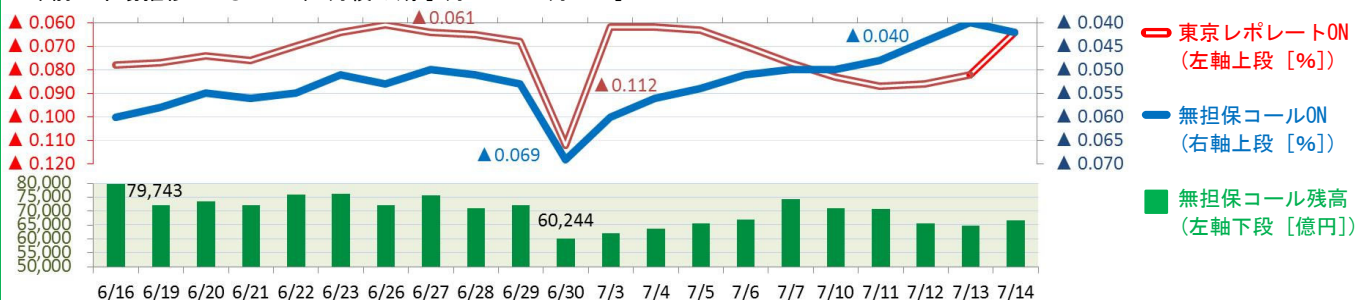
6月29日	3ヶ月	第76/回
7月6日	3ヶ月	
7月9日	6ヶ月	
7月13日	3ヶ月	
国債入札予定		
6月28日	2年	
7月3日	10年	
7月5日	30年	
7月10日	5年	

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13日	0
1年超3年以下	2,000~3,000 程度	2,500			
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,000	4 6 14 22 27	29	6月27日 1
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,300	1 6 13 20 27	29	6月22日 1
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,900			
25年超	500~1,500 程度	700	4 8 14 20 27		6月27日 0
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。

上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会