

短期市場の推移

	6月8日	6月9日	6月10日	6月11日
加重平均金利	▲0.055	▲0.048	▲0.038	▲0.031
東京レポレート(ON)	▲0.084	▲0.064	▲0.059	▲0.048
無コール残	124,046	121,033	113,058	111,675
ON	74,032	71,014	65,544	63,311
その他	50,014	50,019	47,514	48,364
有コール残	18,437	19,044	19,525	18,427

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15日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀金融政策決定会合(1日目)		18:00	(欧)4月貿易収支
			-

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	▲0.080	0.001	▲0.023	▲0.059
T/N	-	-	▲0.050	▲0.054
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.065	0.001	▲0.043	▲0.071
2W	▲0.068	0.000	▲0.053	▲0.081
3W	-	-	-	▲0.091
1M	-	-	▲0.020	▲0.108
2M	-	-	0.100	-
3M	-	-	-	▲0.122
6M	-	-	-	▲0.162
1Y	-	-	-	▲0.187

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▲0.025%の出合から始まり、その後は主に▲0.03%~▲0.015%のレンジで出合が見られた。週末3日積みであり大手行を中心に調達ニーズが強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.008%の▲0.023%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.035 ~ ▲0.020	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.030 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの動向に大きな変化はなく、引き続き堅調な地合いになると予想する。

資金需給

	日銀速報 6月12日	日銀予想 6月15日	当社需給予想 6月16日
券	▲900	▲100	+0
財政	▲3,500	+22,900	▲33,000
過不足	▲4,400	+22,800	▲33,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+30,000		
国債買入		+7,000	
共通担保(全店)		+2,300	
CP等買入	▲700	▲500	
社債等買入	▲700	+3,000	
ETF買入	+100		
被災地金融機関支援	▲900	+500	
国債補完供給	+500	▲300	+300
米ドル資金供給用担保国債供給	+9,500		
当座預金増減	+33,600	+30,900	▲33,000
当座預金残高	4,199,700	4,230,600	4,197,600
準備預金残高	3,629,100	主な需給要因	
積み終了先	3,629,100		
超過準備	3,628,900		
非準備預金残高	570,600		
準備預金進捗率	100.0%	年金定時払い	国庫短期証券
平均	96.8%	発行・償還(3M)	発行(6M)
乖離率	3.2%		

6月12日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(6/15~)						
1~3年	3,400	11,716	3,403	0.003	0.004	51.4
3~5年	3,200	10,226	3,206	▲0.001	0.000	79.6
物価連動	300	1,117	301	▲0.270	▲0.324	8.2
米ドル資金供給(6/16~6/23)						
			0	0	0.350	0.350
CP等買入(6/17~)	6,000	12,864	5,980	▲0.010	▲0.006	60.3
国債補完供給(6/12~6/15)						
			291	291	▲0.350	▲0.350
			0	0		
共通担保(全店)(6/15~6/29)	20,000	2,250	2,250			

マナタリーベース [億円]
 6月11日時点 5,331,600

所要 [億円]
 今積期の所要準備額 3,399,300
 6月15日以降の残り所要積数 0
 平均 0

国庫短期証券入札予定

6月15日	6ヶ月	第915回
6月18日	1年	第916回
6月19日	3ヶ月	第917回
6月26日	3ヶ月	
6月18日	5年	
6月25日	20年	
6月30日	2年	
7月2日	10年	

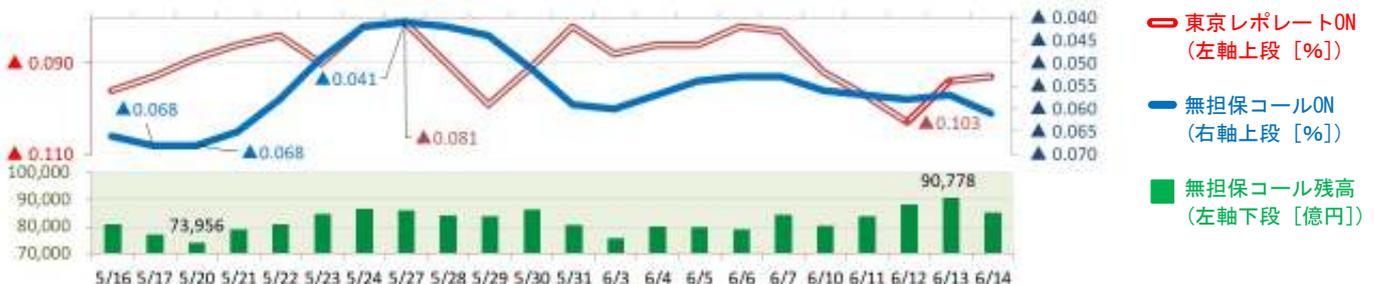
今月の国債買入オペ予定

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
1年以下	500~1,000	800	月3回程度	6月10日	1
1年超3年以下	2,000~5,000	3,400	1 5 12 17 22 26	6月12日	3
3年超5年以下	2,000~4,500	3,200	3 5 10 12 22 26	6月12日	2
5年超10年以下	2,500~5,500	4,000	5 10 17 22 29	6月10日	3
10年超25年以下	500~2,000	1,200	3 29	6月3日	1
25年超	0~500	300	1 17	6月1日	1
物価連動債	300	300	月2回程度	6月12日	0
変動利付債<偶数月>	1,000	1,000	1回	6月3日	0

1年前の市場推移

○2019年5月積み期 [5月16日~6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。