

短期市場の推移

[億円] [%]

	6月16日	6月17日	6月18日	6月19日
加重平均金利	▲0.056	▲0.055	▲0.055	▲0.042
東京レポレート(ON)	▲0.054	▲0.069	▲0.079	▲0.088
無コール残	118,004	113,724	120,727	121,747
ON	69,675	64,140	71,353	71,873
その他	48,329	49,584	49,374	49,874
有コール残	19,381	19,834	19,361	19,824

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。

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	▲0.045	▲0.069
T/N	-	-	-	▲0.060
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.075	▲0.020	▲0.065	▲0.069
2W	-	-	-	▲0.082
3W	-	-	-	▲0.089
1M	-	-	-	▲0.098
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.115
6M	-	-	-	▲0.165
1Y	-	-	-	▲0.189

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

6月23日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:00	営業毎旬報告(6月20日現在)	-	17:00	(欧)6月製造業購買担当者指数(PMI)
14:00	基調的なインフレ率を捕捉するための指標	-	22:45	(米)6月製造業購買担当者指数(PMI)
	-	-	23:00	(米)5月新築住宅販売件数

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.045%の出合から始まり、その後は主に▲0.065%~▲0.040%のレンジで出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.003%の▲0.045%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.045	▲0.065 ~ ▲0.035	▲0.070 ~ ▲0.040

翌営業日のマーケット

引き続き大手行の出合が中心となり、出合水準は横ばい圏の見込み。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	6月22日	6月23日	6月24日
券	▲800	▲1,500	▲1,000
財政	+75,000	▲800	+1,000
過不足	+74,200	▲2,300	+0
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+10,800	
CP等買入	▲100	▲500	
ETF買入		+300	
国債補完供給	+100	+100	
当座預金増減	+74,100	+8,400	+0
当座預金残高	4,375,600	4,384,000	4,384,000
準備預金残高	3,753,200	主な需給要因	
積み終了先	3,751,700		
超過準備	3,750,400		
非準備先残高	622,400		
準備預金進捗率	99.6%		
平均	23.3%		
乖離率	76.3%		

6月22日のオペ結果 [円][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(6/23~)						
1~3年	3,400	8,958	3,404	0.007	0.007	67.0
3~5年	3,200	8,713	3,205	0.001	0.002	78.3
5~10年	4,000	5,832	4,005	▲0.004	▲0.002	73.9
米ドル資金供給(6/24~7/1)						
	158	158	0.340	0.340		
国債補完供給(6/22~6/23)						
	67	67	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円] 所要 [億円]
6月19日時点 5,473,000 今積期の所要準備額 3,320,800

6月23日以降の残り所要
積数 12,000
平均 500

国庫短期証券入札予定

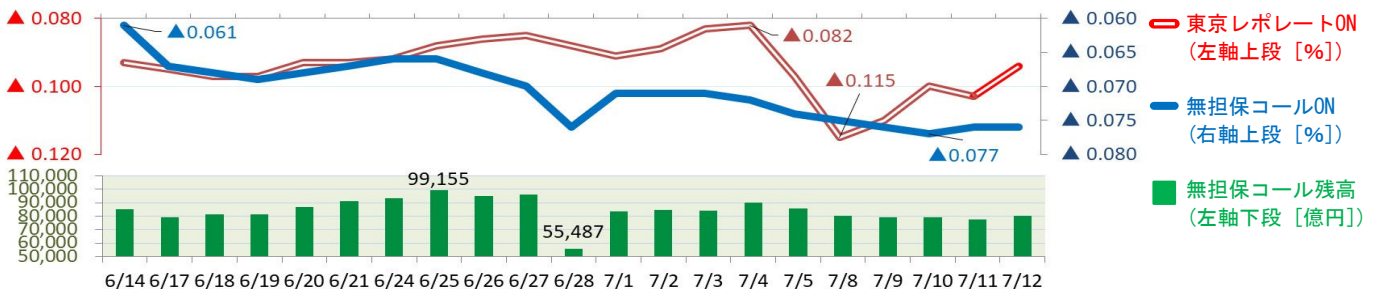
6月26日	3ヶ月	第918回
7月3日	3ヶ月	
7月9日	6ヶ月	
7月10日	3ヶ月	
国債入札予定		
6月25日	20年	
6月30日	2年	
7月2日	10年	
7月7日	30年	

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22日	1
3年超5年以下	2,000~4,500	3,200	3 5 10 12 22 26	6月22日	1
5年超10年以下	2,500~5,500	4,000	5 10 17 22 29	6月22日	1
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17日	0
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6月積み期 [6月14日~7月12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。