

短期市場の推移

	6月3日	6月4日	6月5日	6月8日
加重平均金利	▲0.068	▲0.064	▲0.057	▲0.055
東京レポレート(ON)	▲0.097	▲0.098	▲0.094	▲0.084
無コール残	127,334	136,031	135,147	124,046
ON	78,270	84,067	84,513	74,032
その他	49,064	51,964	50,634	50,014
有コール残	18,750	21,079	18,642	18,437

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10日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	5月国内企業物価指数 [前年比]	▲2.5%		
			21:30	(米)5月消費者物価コア 指数[前年比]
				1.3%

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	▲0.087	0.001	▲0.048	▲0.064
T/N	-	-	-	▲0.062
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.025	▲0.033	▲0.072
2W	-	-	-	▲0.082
3W	-	-	-	▲0.095
1M	-	-	-	▲0.108
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.120
6M	-	-	-	▲0.164
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▲0.050%の出合から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.045%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.007%の▲0.048%となった。
日本銀行当座預金のマクロ加算残高にかかる基準比率の見直しが行われ、6月積み期の基準比率は前積み期対比▲1.5%の28.5%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.045	▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.060 ~ ▲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、出合水準は上昇の見込み。

資金需給

	日銀速報 6月9日	日銀予想 6月10日	当社需給予想 6月11日
券	▲300	▲100	+0
財政	+9,400	▲7,600	+1,000
過不足	+9,100	▲7,700	+1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲500	+6,000	▲700
ETF買入			+1,000
国債補完供給	+400	▲500	+500
米ドル資金供給用担保国債供給			▲7,300
新型コロナ対応金融支援特別			+15,600
当座預金増減	+14,500	+1,400	+1,000
当座預金残高	4,154,700	4,156,100	4,157,100
準備預金残高	3,584,900	主な需給要因	
積み終了先	3,584,600		
超過準備	3,584,600		
非準備先残高	569,800	国庫短期証券 発行・償還(6M)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	80.6%		
乖離率	19.3%		

6月9日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
米ドル資金供給(6/11~6/18)		7,933	7,933	0.330	0.330	
米ドル資金供給(6/11~9/3)		15,890	15,890	0.330	0.330	
社債等買入(6/15~)	3,000	3,757	3,003	▲0.140	▲0.114	12.3
国債補完供給(6/9~6/10)	461	461	▲0.350	▲0.350		
米ドル資金供給用担保国債供給(6/10~6/19)	10,000	6,189	6,189	▲0.100	▲0.100	
米ドル資金供給用担保国債供給(6/10~9/4)	5,000	1,027	1,027	▲0.100	▲0.100	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
6月8日時点 5,304,100	今積期の所要準備額 3,399,300
	6月10日以降の残り所要積数 1,200
	平均 200

国庫短期証券入札予定

6月12日	3ヶ月	第914回
6月15日	6ヶ月	第915回
6月18日	1年	
6月19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	

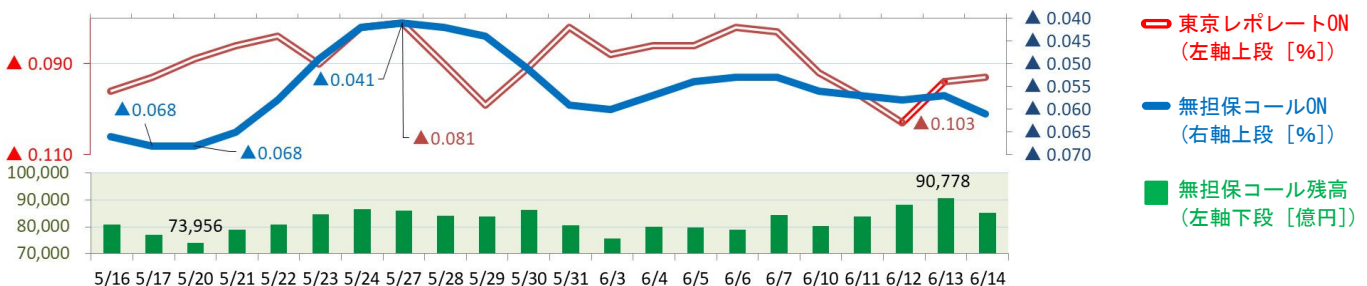
今月の国債買入オペ予定

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3日	2
1年超3年以下	2,000~5,000	3,400	1 5 12 17 22 26	6月5日	4
3年超5年以下	2,000~4,500	3,200	3 5 10 12 22 26	6月5日	4
5年超10年以下	2,500~5,500	4,000	5 10 17 22 29	6月5日	4
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
物価運動債	300	300	月2回程度	6月1日	1
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。 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