

短期市場の推移

	6月3日	6月4日	6月5日	6月6日
加重平均金利	▲0.060	▲0.057	▲0.054	▲0.053
東京レポレート(ON)	▲0.088	▲0.086	▲0.086	▲0.082
無コール残	75,534	79,891	79,638	78,889
ON	46,279	49,716	49,983	49,509
その他	29,255	30,175	29,655	29,380
有コール残	18,982	20,629	20,230	20,101

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	4月国際収支(経常収支)	15151億円	23:00 (米)4月JOLT求人数	749.6万件
8:50	国内総生産(GDP)改定値[前期比年率]	+2.2%	-	-
	第9回債券市場参加者会合(日銀、11日まで)	-	-	-

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	▲0.053	▲0.083
T/N	-	-	-	▲0.090
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	0.000	▲0.033	▲0.096
2W	-	-	-	▲0.103
3W	-	-	-	▲0.122
1M	-	-	-	▲0.127
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.130
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.157

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%の合出から始まった。その後は主に▲0.070%~▲0.040%の水準で取引された。同加重平均金利は前営業日対比横ばいの▲0.053%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.055	▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.065 ~ ▲0.040

翌営業日のマーケット

調達サイドの動向に大きな変化はなく、出合いの水準は本日と横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月7日	6月10日	6月10日	6月11日	6月11日	6月11日
券	+400	+900	+900	+0	+0	+0
財政	▲100	▲10,300	▲10,300	+3,000	+3,000	+3,000
過不足	+300	▲9,400	▲9,400	+3,000	+3,000	+3,000
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				+7,900		
共通担保(全店)	▲400	+2,500	▲2,700	+2,500		
CP等買入		+400	▲100			
ETF買入		+400				
国債補完供給		▲100	+100			
当座預金増減	+2,700	▲1,700	▲1,700	+3,000	+3,000	+3,000
当座預金残高	3,922,700	3,921,000	3,921,000	3,924,000	3,924,000	3,924,000
準備預金残高	3,442,200					
積み終了先	3,442,000					
超過準備	3,442,000					
非準備預金残高	480,500					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	80.6%					
乖離率	19.3%					

6月7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(6/10~)						
5~10年	4,800	13,291	4,800	▲0.003	▲0.003	96.0
10~25年	2,000	4,578	2,003	▲0.011	▲0.008	20.0
25年~	400	1,335	404	▲0.019	▲0.016	7.0
国債補完供給(6/7~6/10)						
	89,066	125	125	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(6/10~6/24)						
	15,000	2,493	2,493			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
6月6日時点 5,036,200	今積期の所要準備額 3,198,000
	6月10日以降の残り所要積数 900
	平均 100

国庫短期証券入札予定

6月14日	3ヶ月	第838回
6月19日	1年	
6月21日	3ヶ月	
6月28日	3ヶ月	
国債入札予定		
6月13日	30年	
6月18日	5年	
6月25日	20年	
6月27日	2年	

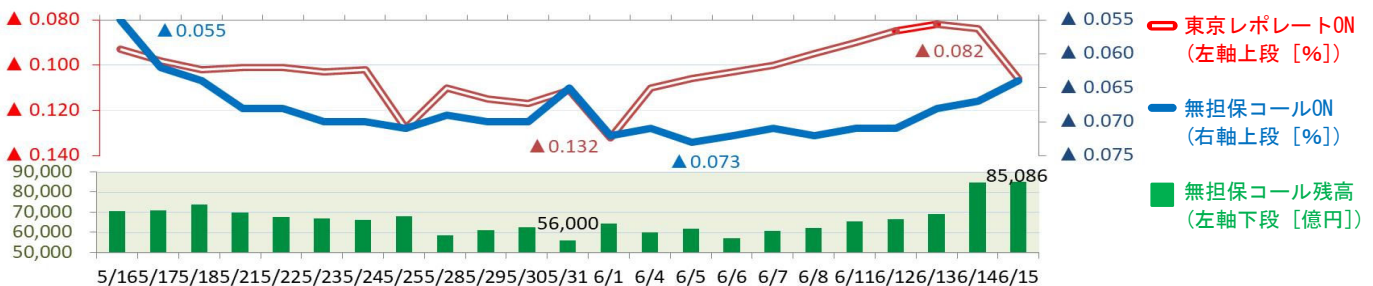
今月の国債買入オペ予定

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3日	1
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	3 10 21 26	6月3日	3
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	7 14 21 28	6月7日	3
10年超25年以下	1,000~3,000 程度	2,000			
25年超	100~1,000 程度	400	7 19 28	6月7日	2
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	5月21日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	4月10日	1

1年前の市場推移

○2018年5月積み期 [5月16日~6月15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