

短期市場の推移

	6月5日	6月6日	6月7日	6月10日
加重平均金利	▲0.054	▲0.053	▲0.053	▲0.056
東京レポレート(ON)	▲0.086	▲0.082	▲0.083	▲0.092
無コール残	79,638	78,889	84,510	80,363
ON	49,983	49,509	54,630	49,783
その他	29,655	29,380	29,880	30,580
有コール残	20,230	20,101	21,334	19,814

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12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]	+0.7%	20:00 (米)MBA住宅ローン申請 指数[前週比]	-
17:00頃 日本銀行が保有する国 債の銘柄別残高	-	21:30 (米)5月消費者物価 コア指数[前年比]	2.1%

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	▲0.057	▲0.097
T/N	-	-	-	▲0.111
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.001	▲0.112
2W	-	-	▲0.030	▲0.118
3W	-	-	0.025	▲0.131
1M	-	-	-	▲0.132
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.133
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、▲0.055%の出合から始まった。
 その後は主に▲0.07%~▲0.050%の水準で取引された。
 同加重平均金利は前営業日対比▲0.001%の▲0.057%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.060	▲0.060 ~ ▲0.055	▲0.070 ~ ▲0.045

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11日	6月12日	6月12日	6月13日	6月13日	6月13日
券	+400	+200	+400	+200	▲1,000	▲1,000
財政	▲2,200	▲5,500	▲2,200	▲5,500	+1,000	+1,000
過不足	▲1,800	▲5,300	▲1,800	▲5,300	+0	+0
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
国庫短期証券買入				+5,000		
国債買入		+7,900		▲600		
CP等買入	▲100			▲100		
社債等買入						
ETF買入		+700		+700		
国債補完供給	+100	▲200		+200		
当座預金増減	+6,600	▲100	+6,600	▲100	+0	+0
当座預金残高	3,932,200	3,932,100	3,932,200	3,932,100	3,932,100	3,932,100
準備預金残高	3,443,300		3,443,300			
積み終了先	3,443,100		3,443,100			
超過準備	3,443,100		3,443,100			
非準備預金残高	488,900		488,900			
準備預金進捗率	99.9%		99.9%			
平均	87.1%		87.1%			
乖離率	12.8%		12.8%			

6月11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
国庫短期証券買入(6/12~)	5,000	21,156	5,006	0.006	0.011	6.2
米ドル資金供給(6/13~6/20)			0	2.870	2.870	
CP等買入(6/14~)	2,500	5,822	2,480	▲0.003	▲0.002	80.6
国債補完供給(6/11~6/12)	109,745	91	91	▲0.350	▲0.350	
	34,837	135	135	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
6月10日時点 5,040,600	今積期の所要準備額 3,198,000
	6月12日以降の残り所要積数 500
	平均 100

国庫短期証券入札予定

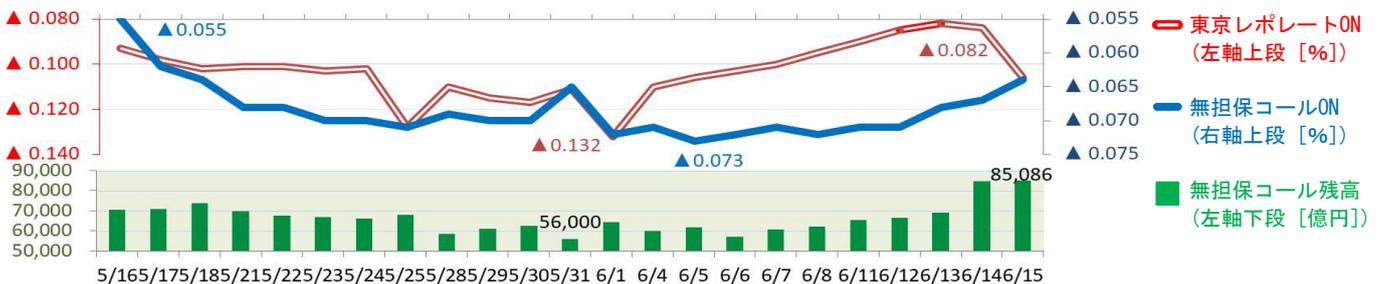
6月14日	3ヶ月	第838回
6月19日	1年	
6月21日	3ヶ月	
6月28日	3ヶ月	
国債入札予定		
6月13日	30年	
6月18日	5年	
6月25日	20年	
6月27日	2年	

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10日	2
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	6月10日	1
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。