

短期市場の推移

[億円][%]

	6月7日	6月10日	6月11日	6月12日
加重平均金利	▲0.053	▲0.056	▲0.057	▲0.058
東京レポレート(ON)	▲0.083	▲0.092	▲0.097	▲0.103
無コール残	84,510	80,363	83,933	88,333
ON	54,630	49,783	53,653	56,553
その他	29,880	30,580	30,280	31,780
有コール残	21,334	19,814	20,069	21,987

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14日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
14:00	【講演】池田理事 (第8回FinTechフォーラム)	21:30	(米)5月小売売上高 0.6%
-	-	22:15	(米)5月鉱工業生産指数 [前月比] 0.2%
-	-	23:00	(米)6月ミシガン大学 消費者信頼感指数速報 97.0

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	▲0.086	0.001	▲0.057	▲0.094
T/N	-	-	-	▲0.127
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.047	▲0.040	▲0.042	▲0.130
2W	▲0.050	▲0.020	▲0.042	▲0.132
3W	-	-	0.025	▲0.136
1M	-	-	-	▲0.134
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.134
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、▲0.060%の合出から始まった。その後は主に▲0.070%~▲0.045%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 ~ ▲0.065	▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.070 ~ ▲0.040

翌営業日のマーケット

積み期最終日にはあるものの、調達ニーズは限定的で、出合いの水準は低下すると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報 6月13日	日銀予想 6月14日	当社需給予想 6月17日
券	▲800	▲400	+0
財政	+4,400	+66,600	+10,000
過不足	+3,600	+66,200	+10,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)		▲700	+600
CP等買入	▲100	▲200	+2,500
社債等買入	▲100	▲200	
ETF買入	+100		+800
被災地金融機関支援		▲2,300	+900
国債補完供給	+800	+400	
当座預金増減	+3,900	+68,000	+10,000
当座預金残高	3,934,900	4,002,900	4,012,900
準備預金残高	3,438,100	主な需給要因	
積み終了先	3,438,000		
超過準備	3,438,000		
非準備預金残高	496,800	年金定時払い	
準備預金進捗率	99.9%	国債償還(2年)	
平均	93.5%	国庫短期証券発行・償還(3M)	
乖離率	6.4%		

6月13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
国債補完供給(6/13~6/14)	235,442	365	365	▲0.350	▲0.350	
共通担保(全店)(6/14~7/1)	15,000	593	593			

マナタリーベース [億円]
6月12日時点 5,045,400

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,198,000
6月14日以降の残り所要積数	300
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	第839回
6月21日	3ヶ月	
6月28日	3ヶ月	
6月18日	5年	
6月25日	20年	
6月27日	2年	
7月2日	10年	

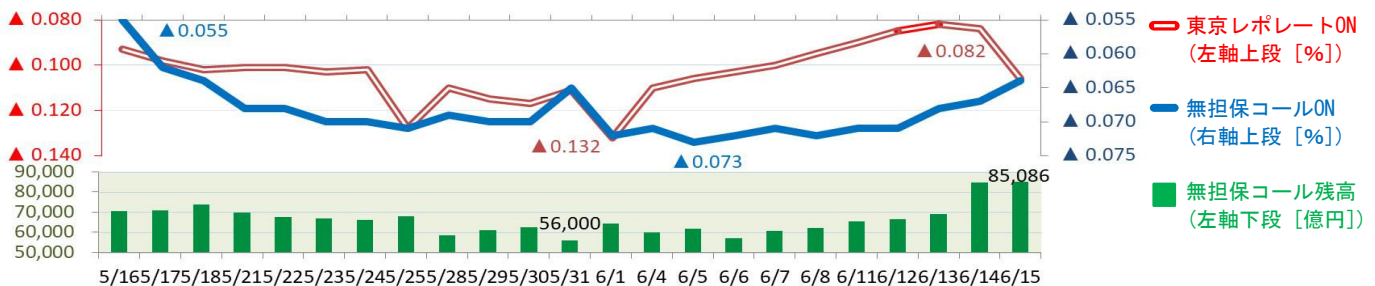
今月の国債買入オペ予定

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	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。 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