

短期市場の推移

[億円] [%]

	6月11日	6月12日	6月13日	6月14日
加重平均金利	▲0.057	▲0.058	▲0.057	▲0.061
東京レポレート(ON)	▲0.097	▲0.103	▲0.094	▲0.093
無コール残	83,933	88,333	90,778	85,087
ON	53,653	56,553	58,488	56,807
その他	30,280	31,780	32,290	28,280
有コール残	20,069	21,987	24,357	24,718

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18日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 (米)5月住宅着工件数	124.0万戸
-	-	21:30 (米)5月住宅建設許可件数	130.0万戸
-	-	-	-

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

本日の市況

	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	▲0.085	0.001	▲0.067	▲0.095
T/N	-	-	-	▲0.109
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	▲0.040	▲0.064	▲0.115
2W	-	-	-	▲0.136
3W	-	-	-	▲0.130
1M	-	-	▲0.040	▲0.128
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.132
6M	-	-	-	▲0.150
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

積み期初日となる本日の無担保コールON物は、▲0.07%の合出から始まった。その後は主に▲0.080%~▲0.045%の水準で取引された。調達サイドが慎重な姿勢だったことから、同加重平均金利は▲0.067%と前日から0.006%低下した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.075 ~ ▲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

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月17日	6月18日	6月18日	6月19日	6月19日	6月19日
券		+100	▲100	▲1,000		
財政		+2,800	+3,500	▲24,000		
過不足		+2,900	+3,400	▲25,000		
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		+6,000				
CP等買入	▲200		▲200			
社債等買入	▲100					
ETF買入		+700		+1,000		
国債補完供給	+100	▲200	+200			
貸出増加支援					▲21,400	+28,000
当座預金増減		+9,200	+4,400	▲18,400		
当座預金残高		4,011,700	4,016,100	3,997,700		
準備預金残高		3,489,700	主な需給要因			
積み終了先		3,395,200				
超過準備		3,048,300				
非準備先残高		522,000				
準備預金進捗率		96.6%				
平均		6.7%				
乖離率		90.0%				

6月17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(6/17~6/18)	534,511	239	239	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]
6月14日時点 5,118,100

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,090,900
6月18日以降の残り所要
積数 104,000
平均 3.700

国庫短期証券入札予定

6月19日	1年	第839回
6月21日	3ヶ月	第840回
6月28日	3ヶ月	
7月5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	

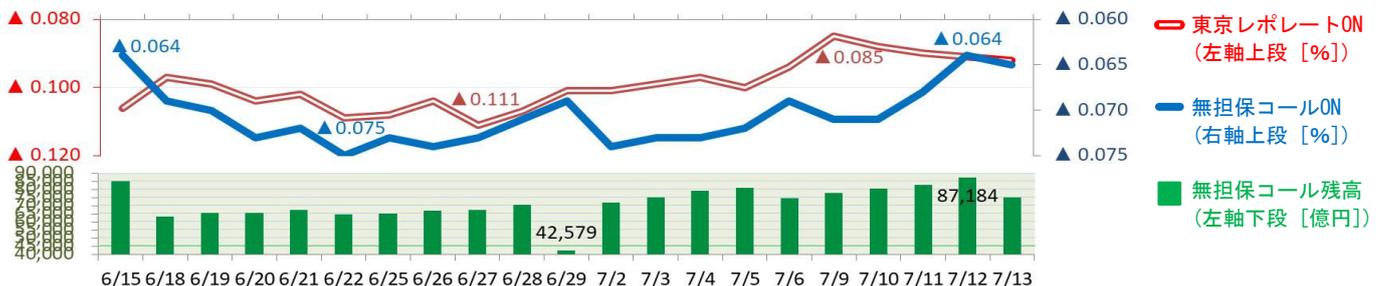
今月の国債買入オペ予定

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14日	2
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	6月14日	0

1年前の市場推移

○2018年6月積み期 [6月15日~7月13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。