

短期市場の推移

[億円][%]

	6月12日	6月13日	6月14日	6月17日
加重平均金利	▲0.058	▲0.057	▲0.061	▲0.067
東京レポレート(ON)	▲0.103	▲0.094	▲0.093	▲0.095
無コール残	88,333	90,778	85,087	79,124
ON	56,553	58,488	56,807	47,334
その他	31,780	32,290	28,280	31,790
有コール残	21,987	24,357	24,718	21,348

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19日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	5月貿易収支	-11873億円	20:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]
14:00頃	実質輸出入の動向	-		(米)FOMCの結果
15:49	【挨拶】衛藤理事(全国信用金庫大会)	-		(米)FRB議長会見

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	▲0.080	0.001	▲0.068	▲0.097
T/N	-	-	-	▲0.105
S/N	-	-	0.001	-
1W	▲0.070	0.230	▲0.022	▲0.110
2W	-	-	-	▲0.129
3W	-	-	-	▲0.127
1M	-	-	-	▲0.125
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.131
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

本日の無担保コールON物は、▲0.07%の出合から始まった。その後は主に▲0.080%~▲0.045%の水準で取引された。同加重平均金利は前営業日対比▲0.001%の▲0.068%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.075	▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.080 ~ ▲0.060

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 6月18日	日銀予想 6月19日	当社需給予想 6月20日
券	▲200	▲500	▲1,000
財政	+4,000	▲20,700	+81,000
過不足	+3,800	▲21,200	+80,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+2,500
CP等買入	▲200	▲100	
ETF買入	+1,000		
国債補完供給	+300		
貸出増加支援		▲26,100	+28,000
当座預金増減	+4,900	▲16,900	+80,000
当座預金残高	4,016,600	3,999,700	4,079,700
準備預金残高	3,489,100	主な需給要因	
積み終了先	3,450,700	国債償還(5年・10年)	
超過準備	3,433,000	国債発行(5年)	
非準備先残高	527,500	国庫短期証券発行・償還(1Y)	
準備預金進捗率	98.4%		
平均	10.0%		
乖離率	88.4%		

6月18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(6/19~)	2,500	11,008	2,504	0.015	0.018	69.4
米ドル資金供給(6/20~6/27)			1	2.850	2.850	
社債等買入(6/24~)	1,250	2,918	1,250	▲0.027	0.032	29.1
国債補完供給(6/18~6/19)	225,756	17	17	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]
6月17日時点 5,127,100

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,090,900
6月19日以降の残り所要積数 48,000
平均 1,800

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	
国債入札予定		
6月25日	20年	
6月27日	2年	
7月2日	10年	
7月4日	30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。