

短期市場の推移

[億円] [%]

	6月20日	6月21日	6月24日	6月25日
加重平均金利	▲0.068	▲0.067	▲0.066	▲0.066
東京レポレート(ON)	▲0.093	▲0.093	▲0.092	▲0.088
無コール残	86,698	91,345	93,555	99,155
ON	52,218	54,915	56,665	62,885
その他	34,480	36,430	36,890	36,270
有コール残	21,803	22,385	22,397	23,877

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27日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:30	【挨拶】若田部副総裁(青森)	-	21:30	(米)1-3月期国内総生産(GDP)確報値[前期比年率] 3.2%
	-	-	21:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分] -
	-	-	-	-

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	▲0.068	▲0.086
T/N	-	-	-	▲0.087
S/N	-	-	0.010	-
1W	-	-	-	▲0.098
2W	▲0.020	▲0.015	▲0.019	▲0.100
3W	-	-	-	▲0.105
1M	-	-	-	▲0.108
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.122
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.159

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、▲0.070%の出合から始まり、その後は主に▲0.080%~▲0.060%のレンジで取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.068%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.075	▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.075 ~ ▲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26日	6月27日	6月27日	6月28日	6月28日	6月29日
券	▲1,300	▲2,200	▲1,300	▲1,500	▲1,300	▲1,500
財政	▲9,500	+4,800	+4,800	+4,900	+4,800	+4,900
過不足	▲10,800	+2,600	+2,600	+3,400	+2,600	+3,400
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		+2,500
CP等買入	▲100		▲800			
社債等買入	▲100					
ETF買入		+300				
当座預金増減	▲5,700	+9,700	+9,700	+5,900	+9,700	+5,900
当座預金残高	4,101,200	4,110,900	4,110,900	4,116,800	4,110,900	4,116,800
準備預金残高	3,578,100	主な需給要因				
積み終了先	3,577,500					
超過準備	3,577,500					
非準備預金残高	523,100					
準備預金進捗率	99.8%					
平均	36.7%					
乖離率	63.2%					

6月26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(6/27~)						
1~3年	3,500	13,796	3,506	0.006	0.006	97.7
3~5年	4,000	20,416	4,014	▲0.003	▲0.002	82.3
物価連動	250	1,572	250	▲0.160	▲0.210	
国債補完供給(6/26~6/27)						
	189,868	1	1	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
6月25日時点 5,228,200	今積期の所要準備額 3,090,900
	6月27日以降の残り所要積数 5,100
	平均 300

国庫短期証券入札予定

6月28日	3ヶ月	第841回
7月5日	3ヶ月	
7月9日	6ヶ月	
7月12日	3ヶ月	
国債入札予定		
6月27日	2年	
7月2日	10年	
7月4日	30年	
7月9日	5年	

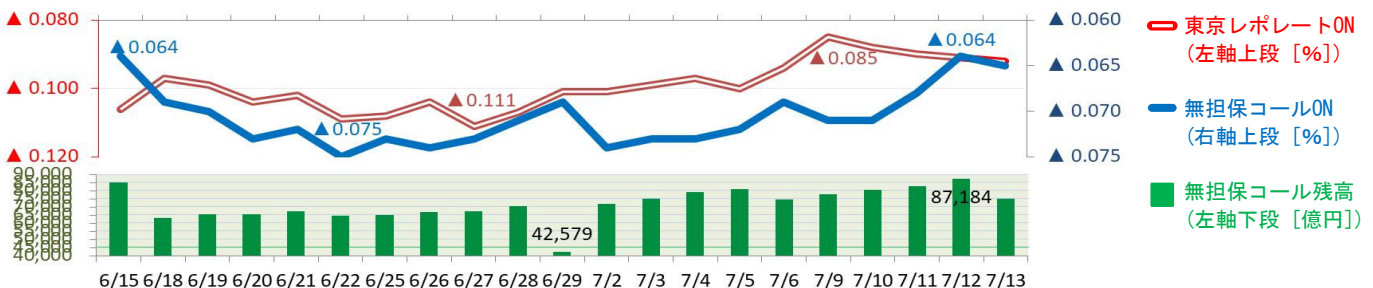
今月の国債買入オペ予定

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19日	0
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26日	0
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	7 14 21 28	6月21日	1
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19日	1
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	6月26日	0
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。