

短期市場の推移 [億円][%]

	6月5日	6月6日	6月7日	6月8日
加重平均金利	▲0.073	▲0.072	▲0.071	▲0.072
東京レポレート(ON)	▲0.106	▲0.103	▲0.100	▲0.095
無コール残	61,876	57,120	60,635	62,238
ON	33,796	29,020	32,045	32,958
その他	28,080	28,100	28,590	29,280
有コール残	19,047	23,651	28,470	29,689

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)

時刻	日本	予想	海外	予想
8:50	企業物価指数(5月)	+2.1%	- (米)FOMC(13日まで)	-
10:00	営業毎旬報告(6月10日現在)	-	21:30 (米)5月消費者物価コア指数[前年比]	+2.2%
-	-	-	-	-

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 東京レポレート
	最低	最高	平均	
O/N	▲0.086	0.001	▲0.071	▲0.090
T/N	-	-	0.000	▲0.093
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.065	0.000	▲0.043	▲0.110
2W	-	-	▲0.030	▲0.115
3W	-	-	0.030	▲0.145
1M	-	-	-	▲0.144
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.070	▲0.145
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.161

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、▲0.085%の出合から始まった。先週に引き続きビッドが薄く、▲0.086%~▲0.060%のレンジで取引された。また、一部で試し取りが行われ、+0.001%での取引が散見された。同加重平均金利(速報)は前日対比+0.001%の▲0.071%となった。

O/N業態別出合レンジ [%]

都銀・信託	証券	地銀
▲ 0.086 ~ ▲ 0.086	▲ 0.085 ~ ▲ 0.085	▲ 0.086 ~ ▲ 0.050

明日のマーケット

明日もビッドが薄く軟調な地合が継続する見込み。主に▲0.086%~▲0.050%で取引されると予想する。

資金需給 [億円]

	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		+800		▲100		+0
財政		▲17,200		+2,900		▲8,000
過不足		▲16,400		+2,800		▲8,000
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
国庫短期証券買入				+12,500		
国債買入		+3,900				
共通担保(全店)	▲1,600	+1,500				
CP等買入	▲400		▲200			
社債等買入	▲100		▲300			
ETF買入		+200		+1,700		
国債補完供給	+400	▲700	+700			
当座預金増減		▲13,200		+17,200		▲8,000
当座預金残高		3,760,300		3,777,500		3,769,500
準備預金残高		3,316,200				
積み終了先		3,316,000				
超過準備		3,316,000				
非準備先残高		444,100				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		87.1%				
乖離率		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	按分
国庫短期証券買入(6/12~)	12,500	42,286	12,503	▲0.005	▲0.003	32.7
国債補完供給(6/11~6/12)	139,845	681	681	▲0.600	▲0.600	
	39,950	24	24	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]

6月8日時点 4,856,100

所要 [億円]

今積期の所要準備額	3,123,100
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764回
6月19日	1年	
6月22日	3ヶ月	
6月29日	3ヶ月	

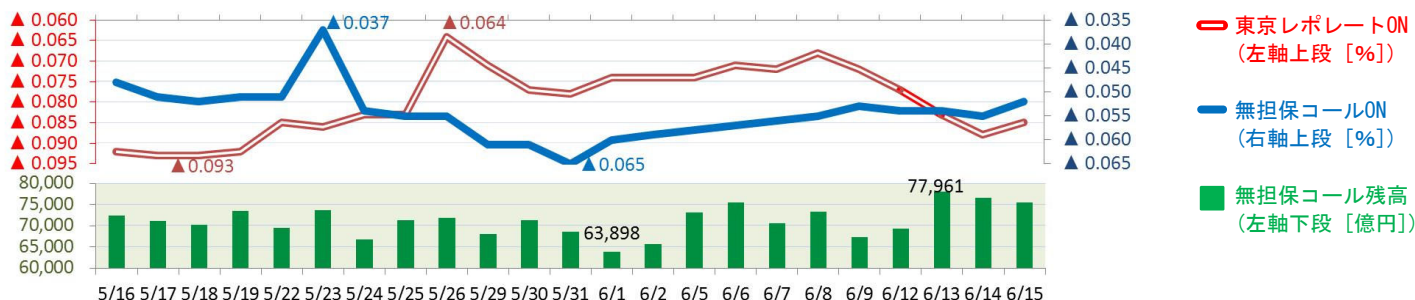
今月の国債買入オペ予定

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1日	1
1年超3年以下	2,000~3,000 程度	2,500	4 6 14 22 27 29	6月6日	4
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,300			
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,300	1 6 13 20 22 29	6月6日	4
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,900			
25年超	500~1,500 程度	700	4 8 14 20 27	6月8日	3
物価連動債	250 程度	250			
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	月2回程度	6月1日	1
			1回	6月8日	0

1年前の市場推移

○2017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(登金) 第243号 加入協会 日本証券業協会