

短期市場の推移 [億円][%]

	6月7日	6月8日	6月11日	6月12日
加重平均金利	▲0.071	▲0.072	▲0.071	▲0.071
東京レポレート(ON)	▲0.100	▲0.095	▲0.090	▲0.085
無コール残	60,635	62,238	65,250	66,320
ON	32,045	32,958	36,100	37,470
その他	28,590	29,280	29,150	28,850
有コール残	28,470	29,689	29,121	30,086

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
	日銀金融政策決定会合(15日まで)		3:00 (米)6月連邦公開市場委員会(FOMC)政策金利	2.00%
13:30	4月の鉱工業生産確報(経産省)		21:30 (米)5月小売売上高	0.4%
	-		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 東京レポレート
	最低	最高	平均	
O/N	▲0.086	0.001	▲0.068	▲0.082
T/N	-	-	0.000	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.062	▲0.020	▲0.053	▲0.105
2W	▲0.055	▲0.010	▲0.047	▲0.115
3W	-	-	0.030	▲0.139
1M	-	-	-	▲0.141
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.144
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%の合出から始まった。昨日に引き続き、主に▲0.086%~▲0.050%の水準で合出がみられた。同加重平均(速報)は前日比+0.003%の▲0.068%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	-	▲ 0.086 ~ ▲ 0.050

明日のマーケット

明日は積調整の調達により本日より堅調な地合となる見込み。取引のレンジは本日と同様▲0.086%~▲0.05%となる見込みだが、合出の中心は本日よりも上昇すると予想。

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15日	
券		+400		▲1,000		▲1,000
財政		▲7,100		+2,600		+84,000
過不足		▲6,700		+1,600		+83,000
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				+5,200		
CP等買入	▲100		▲100			+2,500
社債等買入			▲100			
ETF買入		+500		+900		
被災地金融機関支援			▲900		+2,300	
国債補充供給	+300	▲500	+500			
当座預金増減		▲6,500		+9,400		+85,500
当座預金残高		3,770,200		3,779,600		3,865,100
準備預金残高		3,344,000				
積み終了先		3,343,900				
超過準備		3,343,900				
非準備先残高		426,200				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		93.5%				
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	按分
国債買入(6/14~)						
~1年	500	4,172	500	0.014	0.016	30.6
5~10年	4,300	13,653	4,309	0.001	0.002	46.4
物価連動	250	1,202	251	0.010	▲0.006	45.0
国債補充供給(6/13~6/14)						
	41,806	442	442	▲0.600	▲0.600	

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	第765回
6月22日	3ヶ月	
6月29日	3ヶ月	

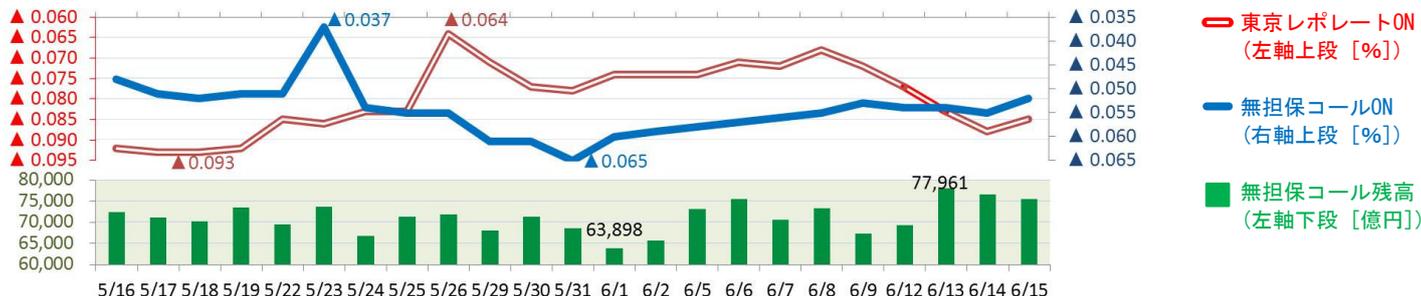
今月の国債買入オペ予定

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