

短期市場の推移

[億円] [%]

	6月8日	6月11日	6月12日	6月13日
加重平均金利	▲0.072	▲0.071	▲0.071	▲0.068
東京レポレート(ON)	▲0.095	▲0.090	▲0.085	▲0.082
無コール残	62,238	65,250	66,320	68,986
ON	32,958	36,100	37,470	40,766
その他	29,280	29,150	28,850	28,220
有コール残	29,689	29,121	30,086	28,461

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15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の結果公表	-	21:30	(米)6月ニューヨーク連銀製造業景気指数
黒田日銀総裁の会見	-	22:15	(米)5月鉱工業生産指数[前月比]
-	-	23:00	(米)6月ミシガン大学消費者信頼感指数速報

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	▲0.067	▲0.084
T/N	-	-	0.000	▲0.109
S/N	-	-	0.001	-
1W	▲0.065	▲0.040	▲0.053	▲0.120
2W	▲0.060	▲0.010	▲0.040	▲0.123
3W	-	-	0.030	▲0.147
1M	-	-	-	▲0.145
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲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協会公表

本日の市況

本日の無担保コールON物は、▲0.086%~▲0.05%のレンジで取引された。昨日よりも▲0.08%~▲0.075%の出合が若干増加したことにより、同加重平均金利(速報)は昨日対比+0.001%の▲0.067%となった。

本日通知された国債の買入では残存3年超5年以下の買入れ額が前回の3,300億円から3,000億円に減額された。

O/N業態別出合レンジ

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.080	-	▲0.085 ~ ▲0.050

明日のマーケット

積み最終日となる明日は、本日よりも地合が強含むと予想する。
出合レンジは本日と同様▲0.086%~▲0.05%となる見込みだが、
出合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	日銀予想	当社需給予想
	6月14日	6月15日	6月18日
券	▲1,100	▲800	+0
財政	+1,200	+82,900	▲3,000
過不足	+100	+82,100	▲3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+5,200	+8,600	スタート
共通担保(全店)			▲2,400
CP等買入	▲100	▲1,000	+2,500
社債等買入	▲100		
ETF買入	+900		
被災地金融機関支援	+2,300		
国債補充供給	+500	+200	
当座預金増減	+7,700	+92,400	▲5,400
当座預金残高	3,777,900	3,870,300	3,864,900
準備預金残高	3,368,600		
積み終了先	3,368,500		
超過準備	3,368,500		
非準備先残高	409,300		
準備預金進捗率	99.9%	年金定時払い	国庫短期証券発行・償還(3M)
平均	96.8%	国債償還(2年)	
乖離率	3.1%		

6月14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(6/15~)						
1~3年	2,500	9,342	2,508	0.002	0.003	42.0
3~5年	3,000	10,375	3,005	▲0.004	▲0.003	21.5
10~25年	1,900	5,983	1,910	▲0.004	▲0.003	34.4
25年~	700	2,328	704	0.002	0.003	66.8
国債補充供給(6/14~6/15)						
	73,112	180	180	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]
6月13日時点 4,851,800

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,123,100
6月15日以降の残り所要
積数 100
平均 100

国庫短期証券入札予定

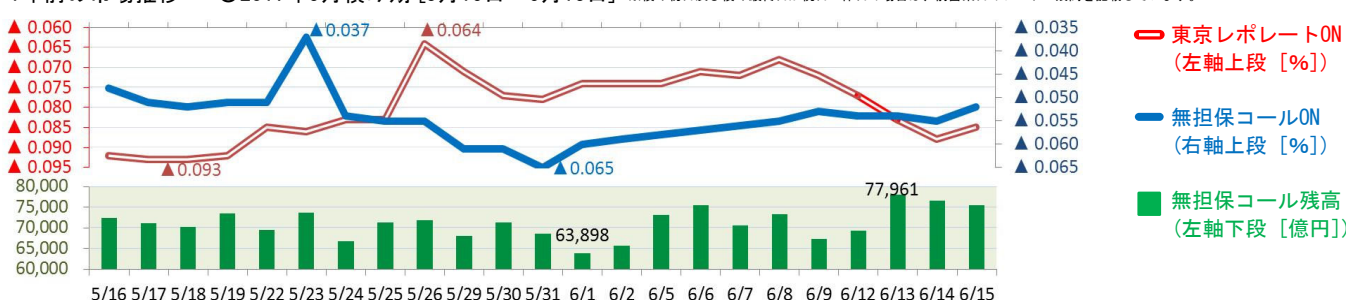
6月19日	1年	第765回
6月22日	3ヶ月	
6月29日	3ヶ月	
7月6日	3ヶ月	
国債入札予定		
6月19日	30年	
6月21日	5年	
6月26日	20年	
6月28日	2年	

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13日	0
1年超3年以下	2,000~3,000 程度	2,500			
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,000	4 6 14 22 27 29	6月14日	3
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,300	1 6 13 20 22 29	6月13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	4 8 14 20 27	6月14日	2
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。