

短期市場の推移

[億円] [%]

	6月11日	6月12日	6月13日	6月14日
加重平均金利	▲0.071	▲0.071	▲0.068	▲0.067
東京レポレート(ON)	▲0.090	▲0.085	▲0.082	▲0.084
無コール残	65,250	66,320	68,986	84,640
ON	36,100	37,470	40,766	51,140
その他	29,150	28,850	28,220	33,500
有コール残	29,121	30,086	28,461	31,668

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18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	▲2,052億円	-	(米)ウリアムズ・新NY連銀 総裁の講演
17:00	業態別の日銀当座 預金残高(5月)	-	-	(米)アトランタ連銀 総裁の講演
-	【記者会見】 黒田総裁(6月15日)	-	-	-

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	▲0.085	0.001	▲0.064	▲0.106
T/N	-	-	0.000	▲0.108
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.057	▲0.050	▲0.054	▲0.123
2W	▲0.055	0.050	▲0.029	▲0.150
3W	-	-	0.030	▲0.145
1M	-	-	-	▲0.147
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

積み最終日となる本日の無担保コールON物は、▲0.075%の出合から始まり、▲0.08%~▲0.05%のレンジで取引された。昨日よりも出合の中心レートが上昇したため、同加重平均金利(速報)は昨日対比+0.003%の▲0.064%となった。
本日まで行われた日銀金融政策決定会合では金融政策運営方針の現状維持が決定された。

O/N業態別出合レンジ

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.070	-	▲0.075 ~ ▲0.055

明日のマーケット

新積み期となる週明けは、ビッドサイドが慎重な調達姿勢になり、軟調な地合を予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報 6月15日	日銀予想 6月18日	当社需給予想 6月19日
券	▲800	+200	▲1,000
財政	+82,700	+2,000	+3,000
過不足	+81,900	+2,200	+2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+8,600	▲2,400	▲2,400
共通担保(全店) CP等買入	▲1,000	+2,500	▲500
国債補完供給	+200		
当座預金増減	+92,200	+1,700	+2,000
当座預金残高	3,870,100	3,871,800	3,873,800
準備預金残高	3,409,500	主な需給要因	
積み終了先	3,409,500	国庫短期証券 発行・償還(3M)	
超過準備	3,409,400		
非準備先残高	460,600		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	100.0%		
乖離率	0.0%		

6月15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
国債補完供給(6/15~6/18)						
	80,962	6	6	▲0.600	▲0.600	
	10,000	1	1	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(6/18~7/2)						
	8,000	2,382	2,382			

マネタリーベース [億円]
6月14日時点 4,860,500

所要 [億円]
来積み期の所要準備額 3,017,200
6月18日以降の残リ所要
積数 103,400
平均 3.700

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

1年前の市場推移

○2017年6月積み期 [6月16日~7月14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。