

短期市場の推移

	6月12日	6月13日	6月14日	6月15日
加重平均金利	▲0.071	▲0.068	▲0.067	▲0.064
東京レポレート(ON)	▲0.085	▲0.082	▲0.084	▲0.106
無コール残	66,320	68,986	84,640	85,086
ON	37,470	40,766	51,140	52,746
その他	28,850	28,220	33,500	32,340
有コール残	30,086	28,461	31,668	24,450

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19日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
6月の月例経済報告(内閣府)	-	(欧) ECB総裁の講演	-
-	-	21:30 (米)5月住宅着工件数	131.5万戸
-	-	21:30 (米)5月住宅建設許可件数	133.5万戸

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	▲0.069	▲0.097
T/N	-	-	0.000	▲0.112
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.075	0.230	▲0.046	▲0.124
2W	-	-	-	▲0.150
3W	-	-	▲0.070	▲0.145
1M	-	-	-	▲0.146
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

積初日となる本日の無担保コールON物は、▲0.085%の合出から始まった。その後は主に、▲0.086%~▲0.065%の水準で取引される軟調な地合となった。同加重平均金利(速報)は前日対比▲0.005%の▲0.069%となった。

O/N業態別合出レンジ

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.085 ~ ▲0.085	▲0.080 ~ ▲0.055

明日のマーケット

本日と同様に、ビッドサイドの調達姿勢は慎重となり、軟調な地合を予想する。取引のレンジは本日と同様▲0.086%~▲0.05%で取引されると予想。

資金需給

	日銀速報 6月18日	日銀予想 6月19日	当社需給予想 6月20日
券	▲100	▲300	▲1,000
財政	+1,300	+900	+60,000
過不足	+1,200	+600	+59,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+7,500
共通担保(全店)	▲2,400	+2,400	
CP等買入	▲500		▲200
社債等買入			▲300
国債補完供給	▲100	+100	
貸出増加支援			▲49,400
			+17,600
当座預金増減	+600	+7,700	+27,200
当座預金残高	3,870,700	3,878,400	3,905,600
準備預金残高	3,400,800	主な需給要因	
積み終了先	3,365,200		
超過準備	3,351,700		
非準備先残高	469,900		
準備預金進捗率	98.2%	国庫短期証券発行・償還(1Y)	
平均	10.0%	国債発行(30年)	
乖離率	88.2%	国債償還(5年・10年)	

6月18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
国庫短期証券買入(6/19~)	7,500	25,842	7,502	▲0.002	▲0.001	16.5
国債補完供給(6/18~6/19)	56,049	62	62	▲0.600	▲0.600	
	9,950	応札無し				

マナタリーベース [億円]
 6月15日時点 4,953,500

所要 [億円]
 今積期の所要準備額 3,017,200
 6月19日以降の残り所要積数 54,300
 平均 2,000

国庫短期証券入札予定

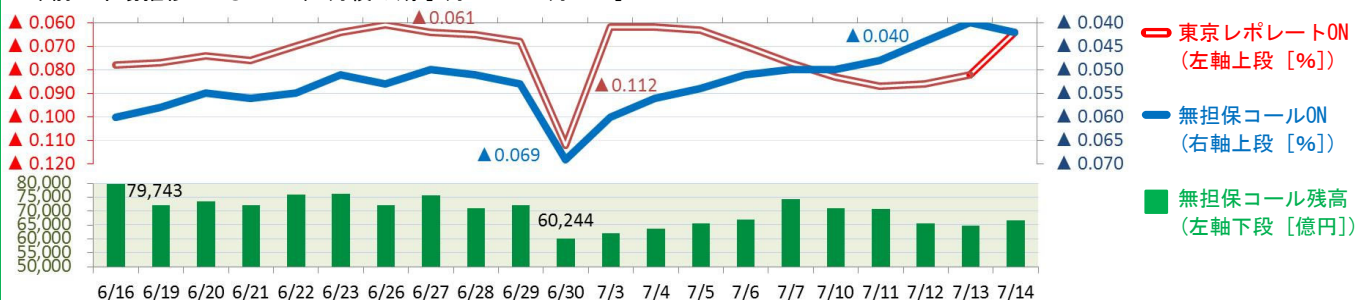
6月19日	1年	第765回
6月22日	3ヶ月	第766回
6月29日	3ヶ月	
7月6日	3ヶ月	
国債入札予定		
6月19日	30年	
6月21日	5年	
6月26日	20年	
6月28日	2年	

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。