

短期市場の推移

	6月19日	6月20日	6月21日	6月22日
加重平均金利	▲0.070	▲0.073	▲0.072	▲0.075
東京レポレート(ON)	▲0.099	▲0.104	▲0.102	▲0.109
無コール残	65,695	65,647	67,546	64,836
ON	37,265	36,057	36,016	33,526
その他	28,430	29,590	31,530	31,310
有コール残	20,816	27,085	20,163	17,808

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26日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 企業向けサービス価格指数(5月)	-	23:00 (米)消費者信頼感指数	127.5
14:00 基調的なインフレ率を捕捉するための指標	-	(米)アトランタ連銀総裁講演	
		(米)ダラス連銀総裁講演	

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	▲0.073	▲0.108
T/N	-	-	0.000	▲0.126
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.160	▲0.170
2W	-	-	-	▲0.155
3W	-	-	-	▲0.146
1M	-	-	0.010	▲0.144
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.143
6M	-	-	-	▲0.150
1Y	-	-	-	▲0.160

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

無担保コールON物は、▲0.085%の出合から始まった。
 主な出合の水準は、先週末と同様の▲0.086%~▲0.050%であった。
 同加重平均金利は前営業日対比+0.002%の▲0.073%となった。

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、軟調な地合が継続する見込み。
 ▲0.086%~▲0.050%の水準で取引されると予想。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	6月25日	6月26日	6月27日
券	▲300	▲1,000	▲1,000
財政	+3,900	+200	▲12,000
過不足	+3,600	▲800	▲13,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+7,500
国債買入			
共通担保(全店)	▲1,500	+9,900	
CP等買入	▲500	+1,300	
社債等買入	▲200	▲200	
国債補完供給	+900	▲400	+400
当座預金増減	+14,900	+6,900	▲13,000
当座預金残高	3,928,000	3,934,900	3,921,900
準備預金残高	3,441,100	主な需給要因	
積み終了先	3,440,700		
超過準備	3,440,700		
非準備先残高	486,900	国債発行(20年)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	33.3%		
乖離率	66.5%		

6月25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(6/26~)	7,500	23,967	7,503	▲0.002	▲0.001	94.8
国債補完供給(6/25~6/26)	41,983	329	329	▲0.600	▲0.600	
	1,000	100	100	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要
6月22日時点 5,001,200	今積期の所要準備額 3,017,200
	6月26日以降の残り所要積数 4,100
	平均 200

国庫短期証券入札予定

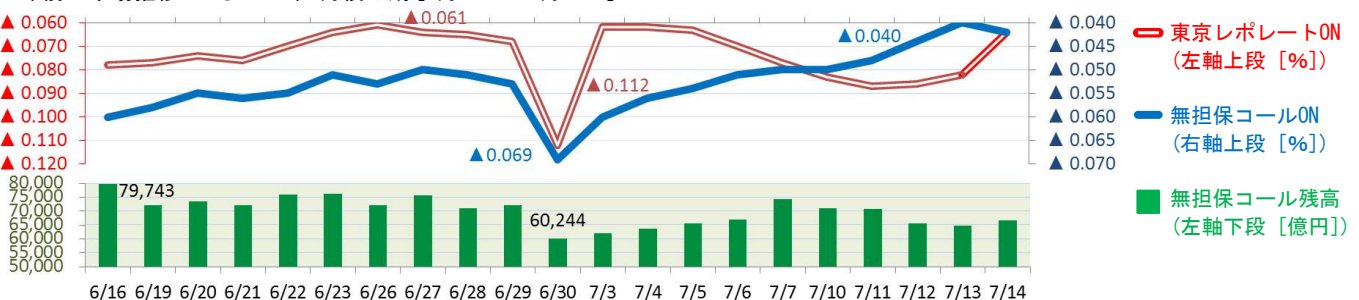
6月29日	3ヶ月	第76/回
7月6日	3ヶ月	
7月9日	6ヶ月	
7月13日	3ヶ月	
6月26日	20年	
6月28日	2年	
7月3日	10年	
7月5日	30年	

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