

短期市場の推移

	6月22日	6月25日	6月26日	6月27日
加重平均金利	▲0.075	▲0.073	▲0.074	▲0.073
東京レポレート(ON)	▲0.109	▲0.108	▲0.104	▲0.111
無コール残	64,836	65,099	66,969	67,501
ON	33,526	33,979	35,964	36,681
その他	31,310	31,120	31,005	30,820
有コール残	17,808	18,214	19,464	17,952

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29日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想	
8:30	5月有効求人倍率(厚労省)	1.59倍	18:00 (欧)6月消費者物価コア指数[前年比]	1.0%
8:30	5月完全失業率(総務省)	+2.5%	21:30 (米)5月個人消費支出	0.4%
19:30頃	6月日銀当座預金増減要因と金融調節(実績速報)	-	23:00 (米)ミシガン大消費者信頼感(確報)	99.2

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	▲0.071	▲0.107
T/N	-	-	-	▲0.118
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.030	▲0.129
2W	▲0.060	0.160	▲0.041	▲0.125
3W	-	-	▲0.020	▲0.126
1M	▲0.055	0.002	▲0.018	▲0.129
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.136
6M	-	-	-	▲0.149
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、▲0.080%の出合から始まった。主な出合の水準は▲0.086%~▲0.050%であった。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.071%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 ~ ▲0.080	▲0.086 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

翌営業日は四半期末となり、調達を控える金融機関が出る見込み。本日に比べ弱い地合になると予想する。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	6月28日	6月29日	7月2日
券	▲1,700	▲900	+1,000
財政	+5,200	+5,700	▲24,000
過不足	+3,500	+4,800	▲23,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+8,700	-	-
共通担保(全店)	-	▲3,600	▲2,400
CP等買入	▲100	+2,500	-
ETF買入	+400	+2,400	-
国債補完供給	+100	+1,400	-
当座預金増減	+11,200	+7,500	▲25,400
当座預金残高	3,930,700	3,938,200	3,912,800
準備預金残高	3,430,800	主な需給要因	
積み終了先	3,430,500	国債発行(2年)	
超過準備	3,430,500	国庫短期証券発行・償還(3M)	
非準備先残高	499,900	マナタリーベース(6月27日時点) 5,010,000	
準備預金進捗率	99.9%	所要(6月29日以降の残り所要)	
平均	43.3%	積数 3,300	
乖離率	56.6%	平均 200	

6月28日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債補完供給(6/28~6/29)	80,878	1,052	1,052	▲0.600	▲0.600	
	4,083	374	374	▲0.600	▲0.600	

国庫短期証券入札予定

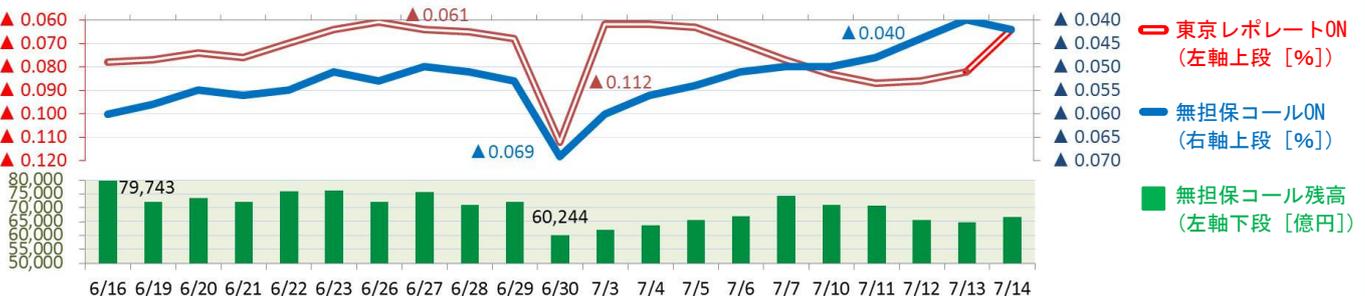
6月29日	3ヶ月	第76/回
7月6日	3ヶ月	
7月9日	6ヶ月	
7月13日	3ヶ月	
7月3日	10年	
7月5日	30年	
7月10日	5年	
7月12日	20年	

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	4	6	14
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,000	29	6	27
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,300	1	6	22
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,900	29	6	22
25年超	500~1,500 程度	700	4	8	14
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。