



短期市場の推移 [徳円] [%]					6月21日の予定 (時刻は日本時間)			
	6月14日	6月15日	6月16日	6月17日	日本		海外	予想
加重平均金利	▲0.034	▲0.023	▲0.042	▲0.040			米	クレーブランド連銀総裁の講演
東京レポレート(TN)	▲0.091	▲0.100	▲0.151	▲0.162				
無コール残	129,182	139,011	138,634	147,246				
ON	57,314	67,893	68,041	74,083				
その他	71,868	71,118	70,593	73,163				
有コール残	30,528	29,782	29,866	29,781				

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。

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 [%]				本日の市況		
無担保コール(速報)			レポ市場	本日の無担保コールON物は▲0.040%の出合から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.035%の水準で取引された。週末要因が剥落し、調達サイドの一部でレートを切り下げる動きが見られたため、出合いの水準は若干の低下となった。本日の無担保コールON物加重平均は前日比▲0.004%の▲0.044%となった。		
	最低	最高	平均	東京レポレート		
O/N	▲0.080	0.001	▲0.044	▲0.114	都銀・信託	▲0.060 ~ ▲0.055
T/N	-	-	▲0.030	▲0.114	証券	▲0.060 ~ ▲0.055
S/N	-	-	-	-	地銀	▲0.055 ~ ▲0.030
1W	-	-	▲0.028	▲0.124	登営業日のマーケット	
2W	-	-	-	▲0.140	市場動向に大きな変化がみられないことから、本日対比横ばい圏での出合を予想。	
3W	-	-	-	▲0.142		
1M	▲0.040	▲0.038	▲0.039	▲0.141		
2M	-	-	-	-		
3M	-	-	-	▲0.127		
6M	-	-	-	▲0.122		
1Y	-	-	-	▲0.117		

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

資金需給 [徳円]				6月20日のオペ結果 [%][徳円] ※米ドル資金供給は百万\$										
		日銀速報		日銀予想		当社需給予想		オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
		6月20日		6月21日		6月22日								
債券			+100		▲400		▲1,000	国庫短期証券買入(6/21~)	1,000	6,910	1,000	0.021	0.021	
財政			+65,900		▲400		▲25,000	国債買入(固定利回り方式)(6/21~)	5~10年	0	0			
過不足			+66,000		▲800		▲26,000	5~10年	0	0				
金融調節	エンド	スタート		エンド	スタート	エンド	スタート	国債補充供給(6/20~6/21)	31,984	31,984	▲0.450	▲0.450		
国庫短期証券買入					+1,000			692	692	▲0.450	▲0.450			
国債買入			+17,500											
共通担保(全店)							▲4,000							
CP等買入		▲100			▲400									
社債等買入		▲600												
国債補充供給		+26,500	▲32,700		+32,700									
貸出増加支援		▲12,300	+46,300											
当座預金増減			+110,600		+32,500		▲30,000							
当座預金残高			5,643,600		5,676,100		5,646,100							
準備預金残高			4,962,700											
積み終了先			4,958,800											
超過準備			4,958,700											
非準備先残高			680,900											
準備預金進捗率			99.9%											
平均			16.7%											
乖離率			83.2%											

マネタリーベース [徳円]	所要 [徳円]
6月17日時点 6,778,700	今積期の所要準備額 3,743,800
	6月21日以降の残り所要積数 5,500
	平均 200

国庫短期証券入札予定		今日の国債買入オペ予定		国債発行 (5Y)						
6月24日	3ヶ月(第1090回)	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			
7月1日	3ヶ月	1年以下	1500	1,500	月1回	6月3日	0			
7月7日	6ヶ月	1年超3年以下	4750	6,250	3 8 15 22	6月15日	1			
7月8日	3ヶ月	3年超5年以下	4750	6,250	3 8 15 29	6月15日	1			
6月21日	5年	5年超10年以下	5000	8,000	8 15 22 29	6月15日	2			
6月23日	20年	10年超25年以下	1250	2,500	8 15 29	6月15日	1			
6月28日	2年	25年超	500	1,500	3 15 22	6月15日	1			
7月5日	10年	物価連動債	600	600	月1回	5月30日	1			
		変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	4月8日	-			



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。 上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会