



短期市場の推移

	6月12日	6月13日	6月16日	6月17日
加重平均金利	0.481	0.477	0.477	0.477
東京レボ レート(TN)	0.489	0.490	0.485	0.483
無コール残	87,629	81,624	82,058	81,364
ON	35,980	32,225	32,639	31,515
その他	51,649	49,399	49,419	49,849
有コール残	30,940	33,220	31,453	31,057

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レボ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。

本日の短期市場金利

[%]

	無担保コール(速報)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボ レート
O/N	0.450	0.650	0.478	0.492
T/N	-	-	-	0.480
S/N	-	-	-	-
1W	0.481	0.610	0.517	0.478
2W	-	-	-	0.477
3W	-	-	-	0.477
1M	0.550	0.560	0.555	0.478
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.487
6M	-	-	-	0.500
1Y	-	-	-	0.569

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月18日		6月19日		6月20日	
券	▲100		▲200		▲1,000	
財政	▲100		+9,200		+32,000	
過不足	▲200		+9,000		+31,000	
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
CP等買入	▲100		▲100		▲100	
社債等買入	▲100		▲200		▲200	
国債補完供給	+600		+800		+800	
貸出増加支援	▲90,300		+70,200		+70,200	
当座預金増減	▲20,600		+9,500		+101,200	
当座預金残高	5,273,900		5,283,400		5,384,600	
準備預金残高	4,800,300		主な需給要因		国庫短期証券発行償 還 (1Y)	
積み終了先	4,781,800		国債発行 (5年)		国債償還 (5年・10 年・20年)	
超過準備	4,752,600					
非準備先残高	473,600					
準備預金進捗率	99.2%					
平均	10.0%					
乖離率	89.2%					

国庫短期証券入札予定

6月19日	1年 (第1313回)
6月20日	3ヶ月(第1314回)
6月27日	3ヶ月
7月4日	3ヶ月

国債入札予定

6月19日	5年
6月24日	20年
6月26日	2年
7月1日	10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	1000	1,000	4				6月4日	0
1年超3年以下	2750	2,750	4	9	13	20	6月13日	1
3年超5年以下	2750	2,750	4	9	13	25	6月13日	1
5年超10年以下	3000	3,000	9	13	20	25	6月13日	2
10年超25年以下	1350	1,350	4	13	20		6月13日	1
25年超	750	750	9	25			6月9日	1
物価連動債	500	500	25				5月29日	1
変動利付債	-	300					4月14日	-

6月19日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-			-	
	-			-	
	-			-	

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の0.478%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477

翌営業日のマーケット

出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

6月18日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
------	------	----	----	----	----	----

国債補完供給(6/18~6/19)

878	878	0.250	0.250
0	0		

マネタリーベース [億円]

6月17日時点 6,510,100

所要

[億円]

今積期の所要準備額	3,995,400
6月19日以降の残り所要 積数	33,700
平均	1,200

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