



短期市場の推移

[億円] [%]

	6月16日	6月17日	6月18日	6月19日
加重平均金利	0.477	0.477	0.478	0.477
東京レボレート(TN)	0.485	0.483	0.480	0.487
無コール残	82,058	81,364	80,776	80,221
ON	32,639	31,515	31,492	31,597
その他	49,419	49,849	49,284	48,624
有コール残	31,453	31,057	31,379	31,209

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	0.478	0.477	0.496
T/N	-	-	-	0.493
S/N	-	-	-	-
1W	0.550	0.570	0.560	0.481
2W	-	-	-	0.477
3W	-	-	0.475	0.478
1M	-	-	-	0.478
2M	-	-	0.570	-
3M	0.580	0.700	0.665	0.484
6M	-	-	-	0.500
1Y	-	-	-	0.570

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20日	6月23日	6月24日
券	+0	▲200	+0
財政	+17,700	▲2,300	+4,000
過不足	+17,700	▲2,500	+4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+7,100	スタート
社債等買入	▲600		
国債補完供給	+300	▲1,500	+1,500
当座預金増減	+15,900	+6,100	+4,000
当座預金残高	5,299,400	5,305,500	5,309,500
準備預金残高	4,837,400	主な需給要因	
積み終了先	4,833,900	国庫短期証券発行償還	
超過準備	4,833,800	(3M)	
非準備先残高	462,000		
準備預金進捗率	99.6%		
平均	23.3%		
乖離率	76.3%		

国庫短期証券入札予定

6月27日	3ヶ月(第1315回)
7月4日	3ヶ月
7月9日	6ヶ月
7月11日	3ヶ月

国債入札予定

6月24日	20年
6月26日	2年
7月1日	10年
7月3日	30年

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオペファー金額	直近オペファー額	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	6月20日 0
3年超5年以下	2750	2,750	4	6月13日 1
5年超10年以下	3000	3,000	9	6月20日 1
10年超25年以下	1350	1,350	4	6月20日 0
25年超	750	750	9	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23日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
14:00	5月の実質輸入の動向		(米) 6月の製造業PMIとサービス業PMI		
	-		(米) ポウマンFRB副議長の講演		
	-		(欧) 6月の製造業PMIとサービス業PMI		

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)は前営業日対比横ばいの0.477%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20日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(6/23~)						
1~3年	2,750	8,528	2,752	0.005	0.007	10.8
5~10年	3,000	6,316	3,007	▲0.003	0.002	22.8
10~25年	1,350	3,183	1,355	0.010	0.012	56.4
国債補完供給(6/20~6/23)						
	1,419	1,419	0.250	0.250		
	62	62	0.250	0.250		

マネタリーベース [億円]

6月19日時点 6,499,400

所要

今積期の所要準備額		3,995,400
6月23日以降の残り所要		
積数	15,500	
平均	700	

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