



短期市場の推移

[億円] [%]

	6月19日	6月20日	6月23日	6月24日
加重平均金利	0.477	0.477	0.476	0.478
東京レボ レート(TN)	0.487	0.493	0.492	0.487
無コール残	80,221	81,180	83,615	85,339
ON	31,597	32,706	32,531	33,035
その他	48,624	48,474	51,084	52,304
有コール残	31,209	31,774	31,324	31,817

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	0.525	0.478	0.490
T/N	-	-	-	0.485
S/N	-	-	-	-
1W	0.481	0.483	0.483	0.476
2W	-	-	-	0.476
3W	-	-	-	0.476
1M	-	-	-	0.477
2M	-	-	0.560	-
3M	-	-	-	0.484
6M	-	-	-	0.500
1Y	-	-	-	0.571

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

6月26日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-			(米) 1~3月のGDP (3次速報値)	
	-			-	
	-			-	

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0.478%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\$

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月25日	6月26日	6月26日	6月27日	6月27日	6月28日
券	▲500	▲900	▲900	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲4,000	+3,000	+3,000	+1,000	+1,000	+1,000
過不足	▲4,500	+2,100	+2,100	+0	+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
国債買入				+7,000		
共通担保(全店)	▲8,000	+8,000				
社債等買入	▲500					
国債補完供給	+3,900	▲1,900	+1,900			
当座預金増減	▲3,000	+11,000	+11,000	+0	+0	+0
当座預金残高	5,298,100	5,309,100	5,309,100	5,309,100	5,309,100	5,309,100
準備預金残高	4,823,600	主な需給要因				
積み終了先	4,822,000					
超過準備	4,822,000					
非準備先残高	474,500					
準備預金進捗率	99.8%					
平均	33.3%					
乖離率	66.4%					

6月25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(6/26~)

3~5年	2,750	6,637	2,754	▲0.004	▲0.003	66.2
5~10年	3,000	4,863	3,003	▲0.018	▲0.014	50.0
25年~	750	1,693	752	▲0.009	▲0.007	100.0
物価連動	500	2,059	501	▲0.060	▲0.189	15.0

国債補完供給(6/25~6/26)

1,976	1,976	0.250	0.250
0	0		

マネタリーベース [億円]

6月24日時点 6,517,900

所要

[億円]

今積期の所要準備額	3,995,400
6月26日以降の残り所要	
積数	9,300
平均	500

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26日	2年
7月1日	10年
7月3日	30年
7月8日	5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20日	0
3年超5年以下	2750	2,750	4	9	13	25	6月25日	0
5年超10年以下	3000	3,000	9	13	20	25	6月25日	0
10年超25年以下	1350	1,350	4	13	20		6月20日	0
25年超	750	750	9	25			6月25日	0
物価連動債	500	500	25				6月25日	0
変動利付債	-	300					4月14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