



短期市場の推移

	6月4日	6月5日	6月8日	6月9日
加重平均金利	0.726	0.727	0.727	0.727
東京レボレート(TN)	0.755	0.755	0.754	0.754
無コール残	90,840	91,299	91,198	92,046
ON	33,086	34,315	32,964	33,162
その他	57,754	56,984	58,234	58,884
有コール残	23,457	24,141	23,712	23,760

[億円] [%]

6月11日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) PPI(5月)	-
-	-	(欧) ラガルドECBの総裁 会見	-
-	-	-	-

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、無コール残は無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	0.700	0.780	0.727	0.751
T/N	-	-	-	0.754
S/N	-	-	-	-
1W	0.765	0.790	0.785	0.778
2W	-	-	-	0.878
3W	-	-	1.200	0.914
1M	-	-	-	0.949
2M	-	-	-	-
3M	-	-	1.210	0.976
6M	-	-	-	0.998
1Y	-	-	-	1.142

本日の市況

無担保コールON物は0.727%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)は前営業対比横ばいの0.727%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.727 ~ 0.727	0.727 ~ 0.727

翌営業日のマーケット

出合いの水準は本対比横ばい圏を予想する。

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

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	6月10日	6月11日	6月12日
券	+0	▲200	▲500
財政	▲11,600	▲1,900	+11,000
過不足	▲11,600	▲2,100	+10,500
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債補完供給	+1,300	+900	+900
共通担保(全店)	▲8,000	+8,000	-
社債等買入	▲100	-	-
当座預金増減	▲11,300	▲1,200	+10,500
当座預金残高	4,364,900	4,363,700	4,374,200
準備預金残高	4,061,200	主な需給要因	
積み終了先	4,061,200	国債発行(30年)	各種財政資金の支払い
超過準備	4,061,200		源泉税揚げ
非準備先残高	303,700		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	83.9%		
乖離率	16.1%		

6月10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(6/10~6/11)	978	978	0.550	0.550		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
6月9日時点 5,569,400

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,212,200
6月11日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

6月12日	3ヶ月(第1387回)
6月18日	1年
6月19日	3ヶ月
6月26日	3ヶ月
6月23日	5年
6月25日	20年
6月30日	2年
7月2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	3	6月3日	0
1年超3年以下	2550	2,550	11 18 26	5月21日	3
3年超5年以下	2300	2,300	3 11 18	6月3日	2
5年超10年以下	2400	2,400	11 18 26	5月28日	3
10年超25年以下	800	800	3 11 18	6月3日	2
25年超	750	750	3 26	6月3日	1
物価連動債	400	400	26	5月28日	1
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