



短期市場の推移

[億円] [%]

	6月10日	6月11日	6月12日	6月15日
加重平均金利	0.727	0.727	0.727	0.727
東京レボ レート(TN)	0.754	0.753	0.755	0.755
無コール残	91,845	92,756	92,409	95,733
ON	32,291	33,752	33,155	35,969
その他	59,554	59,004	59,254	59,764
有コール残	24,326	24,070	24,010	25,265

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重。

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	0.729	0.727	0.735
T/N	-	-	-	0.998
S/N	-	-	-	-
1W	0.993	1.110	1.041	0.998
2W	-	-	1.240	0.998
3W	-	-	-	0.998
1M	1.065	1.230	1.126	0.999
2M	-	-	-	-
3M	-	-	1.190	0.999
6M	-	-	-	1.026
1Y	-	-	-	1.150

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16日	6月17日	6月18日
券	+200	▲700	+0
財政	▲3,000	+13,800	+5,000
過不足	▲2,800	+13,100	+5,000
金融調節	エンド	スタート	スタート
国債補完供給	+4,000	▲2,500	+2,500
社債等買入	▲200		
貸出増加支援			▲70,188
当座預金増減	▲1,500	+15,600	▲65,188
当座預金残高	4,452,100	4,467,700	4,402,512
準備預金残高	4,134,700	主な需給要因	
積み終了先	1,940,300		
超過準備	1,041,400		
非準備先残高	317,400		
準備預金進捗率	75.8%		
平均	3.3%		
乖離率	72.5%		

国庫短期証券入札予定

6月18日	1年 (第1388回)
6月19日	3ヶ月(第1389回)
6月26日	3ヶ月
7月3日	3ヶ月
国債入札予定	
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	一回当たりオペファー金額	直近オペファー額	オペファー予定日	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	6月11日	2
3年超5年以下	2300	2,300	3 11 18	6月11日	1
5年超10年以下	2400	2,400	11 18 26	6月11日	2
10年超25年以下	800	800	3 11 18	6月11日	1
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

6月17日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	貿易収支(5月)		(米) FOMC(2日目)		
	-		(米) 小売売上高(5月)		
	-		(欧) ユーロ圏CPI(5月)		

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。

日銀は金融政策決定会合において、次回会合までの金融市場調節方針として、無担保コールレート(ON物)を1.00%程度で推移するように促すと決定した。

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

出し手・取り手ともに様子見姿勢から入ると思われるが、付利金利との裁定を意識したレートに収束し、0.97%~0.98%近辺の取引を予想する。

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

6月16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(6/16~6/17)

2,664	2,664	0.550	0.550
0	0		

米ドル資金供給(6/18~6/25)

1	1	3.880	3.880
---	---	-------	-------

マネタリーベース [億円]

6月15日時点 5,647,000

所要

[億円]

今積期の所要準備額	4,080,800
6月17日以降の残り所要	
積数	987,500
平均	34,100