



短期市場の推移

	6月16日	6月17日	6月18日	6月19日
加重平均金利	0.727	0.978	0.977	0.977
東京レボレート(TN)	0.998	0.999	1.000	1.002
無コール残	91,330	88,097	87,896	88,171
ON	33,806	33,252	32,581	32,186
その他	57,524	54,845	55,315	55,985
有コール残	24,497	24,747	24,795	25,166

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、無担保コール残は無担保・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	0.950	1.030	0.977	0.997
T/N	-	-	-	1.000
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	1.000
2W	-	-	1.130	1.000
3W	-	-	-	1.000
1M	-	-	-	1.000
2M	-	-	-	-
3M	1.195	1.220	1.205	1.002
6M	-	-	-	1.041
1Y	-	-	-	1.154

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23日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	サービス産業動態統計調査 (4月)		(米)製造業・サービス業PMI (6月)	
	-		(欧)製造業・サービス業PMI (6月)	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は0.977%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0.977%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.977 ~ 0.977	0.977 ~ 0.977

翌営業日のマーケット

出合い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

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	6月22日	6月23日	6月24日
券	▲300	▲500	▲500
財政	+44,100	▲3,400	▲29,000
過不足	+43,800	▲3,900	▲29,500
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債補完供給	+1,200	+2,100	+2,100
社債等買入		▲100	
当座預金増減	+42,900	▲1,900	▲29,500
当座預金残高	4,430,200	4,428,300	4,398,800
準備預金残高	4,106,400	主な需給要因	
積み終了先	4,098,800	国債発行(5年)	
超過準備	4,098,300		
非準備先残高	323,800		
準備預金進捗率	99.4%		
平均	23.3%		
乖離率	76.1%		

6月22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(6/22~6/23)	2,172	2,172	0.750	0.750		
	162	162	0.750	0.750		

マネタリーベース [億円]
6月19日時点 5,581,600

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,080,800
6月23日以降の残り所要	
積数	24,300
平均	1,100

国庫短期証券入札予定

6月26日	3ヶ月(第1390回)
7月3日	3ヶ月
7月8日	6ヶ月
7月10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	1,000	1,000	3		6月3日 0
1年超3年以下	2,550	2,550	11 18 26		6月18日 1
3年超5年以下	2,300	2,300	3 11 18		6月18日 0
5年超10年以下	2,400	2,400	11 18 26		6月18日 1
10年超25年以下	800	800	3 11 18		6月18日 0
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