



短期市場の推移

	6月5日	6月6日	6月7日	6月10日
加重平均金利	0.077	0.077	0.078	0.078
東京レボレート(TN)	0.069	0.056	0.062	0.043
無コール残	80,023	86,268	84,977	79,352
ON	34,113	39,798	39,357	33,242
その他	45,910	46,470	45,620	46,110
有コール残	38,989	39,168	38,165	38,422

6月12日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	企業物価指数 (5月)		(米) FOMC (2日目)		
	-		(米) 消費者物価 (5月)		
	-		-		

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・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	0.050	0.145	0.078	0.088
T/N	-	-	-	0.044
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.350	0.051
2W	-	-	-	0.051
3W	-	-	-	0.051
1M	-	-	-	0.052
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.087
6M	-	-	-	0.134
1Y	-	-	-	0.200

本日の市況

無担保コールON物は0.078%の出合から始まり、その後は主に0.075%~0.078%を中心に取引された。ビットサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.078%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	0.075 ~ 0.078

翌営業日のマーケット

引き続きビットサイドの資金調達ニーズは底堅く、出合の水準は本日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11日	6月12日	6月12日	6月13日	6月13日	6月13日
券	+300	+600	+600	+1,000	+1,000	
財政	▲700	+100	+100	+8,000	+8,000	
過不足	▲400	+700	+700	+9,000	+9,000	
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
共通担保(全店)			▲7,200	+8,000		
CP等買入	▲200		▲100			
国債補完供給	+33,600	▲28,800	+28,800			
当座預金増減	+4,200	+30,200	+30,200	+9,000	+9,000	
当座預金残高	5,395,300	5,425,500	5,425,500	5,434,500	5,434,500	
準備預金残高	4,758,700					主な需給要因
積み終了先	4,758,700					流動性供給
超過準備	4,758,700					源泉税揚げ
非準備先残高	636,600					後期高齢者医療給付費
準備預金進捗率	99.9%					等負担金の支払い等
平均	87.1%					
乖離率	12.8%					

6月11日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
米ドル資金供給(6/13~6/21)	0	0	5,580	5,580		
CP等買入(6/14~)	3,000	4,500	3,000	0.158	0.186	25.0
国債補完供給(6/11~6/12)	29,618	29,618	▲0.250	▲0.250		
共通担保(全店)(6/12~6/26)	8,000	9,740	8,006		82.2	

マネタリーベース (億円)
 6月10日時点 6,629,100

所要	(億円)
今積期の所要準備額	4,081,200
6月12日以降の残り所要	
積数	200
平均	100

国庫短期証券入札予定

6月13日	3ヶ月(第1237回)
6月19日	1年
6月21日	3ヶ月
6月28日	3ヶ月
6月20日	5年
6月25日	20年
6月27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	1500	1,500	月1回	6月7日	0
1年超3年以下	3,000~4,500	3,750	7 12 18 24	6月7日	3
3年超5年以下	3,500~5,000	4,250	12 18 24 28	5月31日	4
5年超10年以下	4,000~5,500	4,250	7 12 18 24	6月7日	3
10年超25年以下	1,000~2,000	1,500	7 18 28	6月7日	2
25年超	500~1,000	750	12 28	5月31日	2
物価連動債	600	600	月1回	5月31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