



短期市場の推移

	6月7日	6月10日	6月11日	6月12日
加重平均金利	0.078	0.078	0.078	0.078
東京レポレート(TN)	0.062	0.043	0.044	0.047
無コール残	84,977	79,352	79,219	76,649
ON	39,357	33,242	33,159	30,689
その他	45,620	46,110	46,060	45,960
有コール残	38,165	38,422	37,848	38,493

6月14日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀政策決定会合 (2日目)		(欧) 4月貿易収支	
-		(欧) ラガルドECB総裁の会見	
-		-	

加重平均金利、コール残高は日銀、東京レポ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)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	0.040	0.078	0.077	0.011
T/N	-	-	-	0.030
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.048
2W	-	-	-	0.049
3W	-	-	-	0.050
1M	0.190	0.220	0.205	0.048
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.200	0.086
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▲0.001%の0.077%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、東京レポ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13日	6月14日	6月14日	6月15日	6月17日
券		▲100	+600		+1,000
財政		▲5,400	+77,200		+5,000
過不足		▲5,500	+77,800		+6,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入		+12,900			
CP等買入	▲200		▲300	+3,000	
社債等買入			▲100		
国債補充供給	+33,300	▲35,100	+35,100		
当座預金増減		+5,400	+115,500		+6,000
当座預金残高		5,396,300	5,511,800		5,517,800
準備預金残高		4,755,400			
積み終了先		4,755,400	流動性供給		国庫短期証券
超過準備		4,755,400	年金定時払い		発行償還(3M)
非準備先残高		640,900			国債発行償還(個人)
準備預金進捗率		99.9%			
平均		93.5%			
乖離率		6.4%			

6月13日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(6/13~6/14)	35,325	35,325	▲0.250	▲0.250		
	607	607	▲0.250	▲0.250		

マネタリーベース (億円)
6月12日時点 6,627,900

所要	(億円)
今積期の所要準備額	4,081,200
6月14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19日	1年 (第1238回)
6月21日	3ヶ月
6月28日	3ヶ月
7月5日	3ヶ月

国債入札予定

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12日	2
3年超5年以下	3,500~5,000	4,250	12 18 24 28	6月12日	3
5年超10年以下	4,000~5,500	4,250	7 12 18 24	6月12日	2
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	6月12日	1
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