



短期市場の推移

	6月14日	6月17日	6月18日	6月19日
加重平均金利	0.077	0.077	0.077	0.077
東京レポレート(TN)	0.032	0.056	0.045	0.058
無コール残	76,746	81,043	82,403	81,552
ON	31,306	34,573	35,306	34,525
その他	45,440	46,470	47,097	47,027
有コール残	38,764	39,348	38,893	39,036

6月21日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	全国消費者物価(5月)		(米) PMI(速報)(6月)		
	-		(欧) PMI(速報)(6月)		
	-		-		

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	0.045	0.079	0.077	0.068
T/N	-	-	-	0.076
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.150	0.049
2W	-	-	-	0.044
3W	-	-	-	0.046
1M	-	-	0.280	0.050
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.083
6M	-	-	0.370	0.138
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0.077%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

ビットサイドの底堅い資金需要に加え、週末要因もあり、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20日	6月21日	6月24日
券	▲400	+300	+0
財政	+59,600	▲27,700	+9,000
過不足	+59,200	▲27,400	+9,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
CP等買入			▲100
社債等買入	▲600	▲200	+800
国債補完供給	+31,700	▲29,100	+29,100
当座預金増減	+61,200	+2,200	+9,000
当座預金残高	5,570,900	5,573,100	5,582,100
準備預金残高	4,926,800	主な需給要因	
積み終了先	4,924,100	国債発行(5年)	国庫短期証券発行償還
超過準備	4,922,700		(3M)
非準備先残高	644,100		
準備預金進捗率	99.7%		
平均	16.7%		
乖離率	83.0%		

6月20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(6/20~6/21)	29,315	29,315	▲0.150	▲0.150		
	400	400	▲0.150	▲0.150		

マネタリーベース	【億円】
6月19日時点	6,745,200

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,942,000
6月21日以降の残り所要	
積数	13,600
平均	500

国庫短期証券入札予定

6月21日	3ヶ月(第1239回)
6月28日	3ヶ月
7月5日	3ヶ月
7月9日	6ヶ月

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18日	1
3年超5年以下	3,500~5,000	4,250	12 18 24 28	6月18日	2
5年超10年以下	4,000~5,500	4,250	7 12 18 24	6月18日	1
10年超25年以下	1,000~2,000	1,500	7 18 28	6月18日	1
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	-

国債入札予定

6月25日	20年
6月27日	2年
7月2日	10年
7月4日	30年

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