



短期市場の推移

	[億円] [%]			
	6月17日	6月18日	6月19日	6月20日
加重平均金利	0.077	0.077	0.077	0.077
東京レポレート(TN)	0.056	0.045	0.058	0.076
無コール残	81,043	82,403	81,552	82,408
ON	34,573	35,306	34,525	35,201
その他	46,470	47,097	47,027	47,207
有コール残	39,348	38,893	39,036	38,858

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	0.078	0.077	0.084
T/N	-	-	-	0.086
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.051
2W	-	-	-	0.050
3W	-	-	-	0.051
1M	-	-	0.165	0.051
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.230	0.084
6M	-	-	-	0.138
1Y	-	-	-	0.200

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

6月24日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	金融政策決定会合における 主な意見 (6月13日・14日分)				
	-				
	-				

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

引き続きビットサイドの資金調達ニーズは旺盛であり、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	6月21日	6月22日	6月24日	6月25日	6月25日
券		+300	+100	+1,000	+1,000
財政		▲33,800	+4,000	+1,000	+1,000
過不足		▲33,500	+4,100	+2,000	+2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲100		▲300		
社債等買入	▲200	+800			
国債補完供給	+29,100	▲25,100	+25,100		
当座預金増減		▲29,000	+28,900	+2,000	+2,000
当座預金残高		5,541,900	5,570,800	5,572,800	5,572,800
準備預金残高		4,915,100			主な需給要因
積み終了先		4,913,400	国庫短期証券発行償還		
超過準備		4,913,100	(3M)		
非準備先残高		626,800			
準備預金進捗率		99.8%			
平均		26.7%			
乖離率		73.1%			

6月21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(6/21~6/24)	25,679	25,679	▲0.150	▲0.150		
	0	0				

マネタリーベース [億円]  
6月20日時点 6,806,800

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,942,000
6月24日以降の残り所要	
積数	7,800
平均	400

国庫短期証券入札予定

6月28日	3ヶ月(第1240回)
7月5日	3ヶ月
7月9日	6ヶ月
7月12日	3ヶ月
6月25日	20年
6月27日	2年
7月2日	10年
7月4日	30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	-

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