



短期市場の推移

	[億円] [%]			
	6月19日	6月20日	6月21日	6月24日
加重平均金利	0.077	0.077	0.077	0.081
東京レボレート(TN)	0.058	0.076	0.086	0.086
無コール残	81,552	82,408	78,950	86,750
ON	34,525	35,201	32,006	40,101
その他	47,027	47,207	46,944	46,649
有コール残	39,036	38,858	38,030	37,748

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	0.065	0.150	0.078	0.077
T/N	-	-	-	0.084
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.280	0.051
2W	-	-	-	0.052
3W	-	-	-	0.052
1M	-	-	-	0.052
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.084
6M	-	-	0.400	0.139
1Y	-	-	-	0.200

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26日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-			-	
	-			-	
	-			-	

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かったが、前日の試し取り要因が剥落したため、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比0.003%低下の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25日	6月26日	6月26日	6月27日	6月27日	6月27日
券		+0		▲100		+0
財政		+5,400		▲17,900		+3,000
過不足		+5,400		▲18,000		+3,000
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
国債買入		+12,200				
共通担保(全店)			▲8,000	+8,000		
CP等買入	▲300		▲200			
社債等買入	▲300					
国債補充供給	+25,000	▲26,900	+26,900			
当座預金増減		+15,100		+8,700		+3,000
当座預金残高		5,554,500		5,563,200		5,566,200
準備預金残高		4,951,600				主な需給要因
積み終了先		4,950,300		国債発行(20年)		
超過準備		4,949,800				
非準備先残高		602,900				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		33.3%				
乖離率		66.6%				

6月25日のオペ結果

[%][億円]*米ドル資金供給は百万\$	
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(6/27~7/5)	0 0 5.580 5.580
CP等買入(6/28~)	3,000 6,250 2,995 0.167 0.184 68.8
国債補充供給(6/25~6/26)	27,512 27,512 ▲0.150 ▲0.164
	0 0
共通担保(全店)(6/26~7/10)	8,000 9,595 8,005 83.4

マネタリーベース [億円]
 6月24日時点 6,774,900

所要 [億円]	
今積期の所要準備額	3,942,000
6月26日以降の残り所要	
積数	4,100
平均	200

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
国債入札予定	
6月27日	2年
7月2日	10年
7月4日	30年
7月9日	5年

今月の国債買入オペ予定

		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
オペ種類	1年以下	1500	1500	1,500	月1回				6月7日	0
	1年超3年以下	3,000~4,500	3,750	3,750	7	12	18	24	6月24日	0
	3年超5年以下	3,500~5,000	4,250	4,250	12	18	24	28	6月24日	1
	5年超10年以下	4,000~5,500	4,250	4,250	7	12	18	24	6月24日	0
	10年超25年以下	1,000~2,000	1,500	1,500	7	18	28		6月18日	1
	25年超	500~1,000	750	750	12	28			6月12日	1
	物価連動債	600	600	600	月1回				5月31日	1
	変動利付債	-	300	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