



短期市場の推移

	6月21日	6月24日	6月25日	6月26日
加重平均金利	0.077	0.081	0.078	0.077
東京レポレート(TN)	0.086	0.086	0.084	0.052
無コール残	78,950	86,750	81,627	79,744
ON	32,006	40,101	35,168	33,545
その他	46,944	46,649	46,459	46,199
有コール残	38,030	37,748	37,581	37,680

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、無有コール残は無担保・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	0.070	0.079	0.077	0.026
T/N	-	-	-	▲0.061
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.027
2W	-	-	0.170	0.038
3W	-	-	-	0.044
1M	0.180	0.190	0.181	0.047
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.210	0.084
6M	-	-	-	0.139
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28日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	有効求人倍率 (5月)		-	
	-		-	
	-		-	

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。ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であり、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

四半期末ではあるが、引き続きビッド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。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	6月27日		6月28日		7月1日
券	▲400		▲100		+0
財政	▲6,500		▲3,400		▲30,000
過不足	▲6,900		▲3,500		▲30,000
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	▲400		▲3,000		+3,000
国債補完供給	+24,000	▲26,600	+26,600		
当座預金増減	▲9,900		+23,100		▲30,000
当座預金残高	5,526,000		5,549,100		5,519,100
準備預金残高	4,918,300		主な需給要因		
積み終了先	4,917,000		国庫短期証券発行償還(3M)		
超過準備	4,916,900		国債発行償還(2年)		
非準備先残高	607,700				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	40.0%				
乖離率	59.9%				

6月27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(6/27~6/28)	27,315	27,315	▲0.150	▲0.150		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
6月26日時点 6,771,500

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,942,000
6月28日以降の残り所要	
積数	1,300
平均	100

国債短期証券入札予定

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

7月2日	10年
7月4日	30年
7月9日	5年
7月11日	20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24日	0
3年超5年以下	3,500~5,000	4,250	12 18 24 28	6月24日	1
5年超10年以下	4,000~5,500	4,250	7 12 18 24	6月24日	0
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