

### 短期市場の推移 [億円][%]

	6月4日	6月5日	6月6日	6月7日
加重平均金利	▲0.071	▲0.073	▲0.072	▲0.071
東京レポレート(ON)	▲0.110	▲0.106	▲0.103	▲0.100
無コール残	60,070	61,876	57,120	60,635
ON	33,490	33,796	29,020	32,045
その他	26,580	28,080	28,100	28,590
有コール残	17,166	19,047	23,651	28,470

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。

### 6月11日の予定(時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
8:50	4月機械受注[前月比]	+2.3%	-	-
8:50	マネーストック(5月)	-	-	-
	-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

### 本日の短期市場金利 [%]

	無担保コール(速報)			レポ市場 東京レポレート
	最低	最高	平均	
O/N	▲0.086	0.001	▲0.072	▲0.095
T/N	-	-	0.000	▲0.100
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	0.003	▲0.060	▲0.117
2W	▲0.055	0.020	▲0.018	▲0.123
3W	-	-	-	▲0.147
1M	-	-	-	▲0.147
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.146
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.161

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

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は、▲0.085%の合出から始まった。その後は昨日に引き続き▲0.086%~▲0.050%で取引される軟調な地合となった。加重平均金利(速報)は▲0.072%となった。

### O/N業態別出合レンジ [%]

都銀・信託	証券	地銀
▲ 0.086 ~ ▲ 0.086	▲ 0.085 ~ ▲ 0.085	▲ 0.086 ~ ▲ 0.050

### 明日のマーケット

明日も軟調な地合が継続する見込み。主に▲0.086%~▲0.050%で取引されると予想する。

### 資金需給 [億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月8日	6月11日	6月11日	6月12日	6月12日	6月12日
券		+300		+900		+0
財政		▲4,000		▲16,000		+2,000
過不足		▲3,700		▲15,100		+2,000
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				+3,900		
共通担保(全店)			▲1,600	+1,500		
CP等買入	▲200	+2,500	▲400			
社債等買入			▲100			
ETF買入		+500		+200		
国債補完供給		▲400	+400			
当座預金増減		▲1,300		▲11,200		+2,000
当座預金残高		3,773,500		3,762,300		3,764,300
準備預金残高		3,310,000				
積み終了先		3,309,900				
超過準備		3,309,800				
非準備先残高		463,500				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		83.9%				
乖離率		16.0%				

### 6月8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
国債買入(6/11~)						
10~25年	1,900	5,720	1,904	▲0.002	0.001	57.5
25年~	700	2,990	704	0.002	0.003	18.1
変動利付	1,000	2,221	1,004	▲0.110	▲0.141	46.7
国債補完供給(6/8~6/11)						
共通担保(全店)	132,835	402	402	▲0.600	▲0.600	
	40,563	1	1	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(6/11~6/25)	8,000	1,520	1,520			

マネタリーベース [億円]  
6月7日時点 4,857,700

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,123,100  
6月11日以降の残り所要積数 700  
平均 100

### 国庫短期証券入札予定

6月14日	3ヶ月	第764回
6月19日	1年	
6月22日	3ヶ月	
6月29日	3ヶ月	
6月19日	30年	
6月21日	5年	
6月26日	20年	
6月28日	2年	

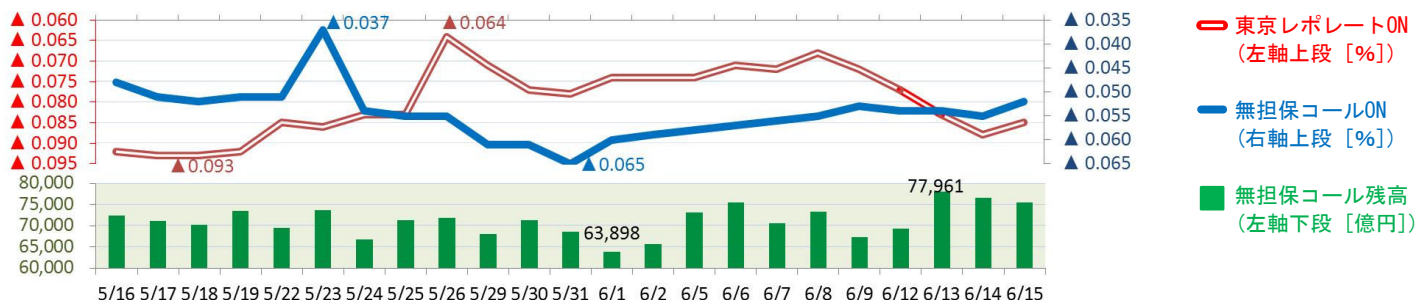
### 今月の国債買入オペ予定

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	100~1,000 程度	500	月2回程度	6月1日	1
1年超3年以下	2,000~3,000 程度	2,500	4	6	14
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,300	4	6	13
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,300	1	6	20
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,900	4	8	14
25年超	500~1,500 程度	700			20
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	6月1日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	6月8日	0

### 1年前の市場推移

○2017年5月積み期 [5月16日~6月15日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



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。