

### 短期市場の推移

[億円][%]

	6月6日	6月7日	6月8日	6月11日
加重平均金利	▲0.072	▲0.071	▲0.072	▲0.071
東京レポレート(ON)	▲0.103	▲0.100	▲0.095	▲0.090
無コール残	57,120	60,635	62,238	65,250
ON	29,020	32,045	32,958	36,100
その他	28,100	28,590	29,280	29,150
有コール残	23,651	28,470	29,689	29,121

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13日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)FOMC2日目 FRB議長の会見	-
-	-	(欧)4月鉱工業生産 指数[前月比]	0.0%
-	-	(米)MBA住宅ローン 申請指数[前週比]	-

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	▲0.071	▲0.085
T/N	-	-	0.000	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.104
2W	▲0.055	0.001	▲0.046	▲0.112
3W	-	-	0.030	▲0.138
1M	-	-	▲0.075	▲0.140
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.144
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%の出入りから始まった。昨日に引き続き、主に▲0.086%~▲0.055%の水準で出合いがみられた。同加重平均(速報)は前日比横ばいの▲0.071%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 ~ ▲ 0.055

### 明日のマーケット

明日もビッドが薄く軟調な地合いが継続する見込み。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12日	6月13日	6月13日	6月14日	6月14日	6月14日
券		▲100		+400		▲1,000
財政		+2,400		▲9,300		+0
過不足		+2,300		▲8,900		▲1,000
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
国庫短期証券買入		+12,500				
CP等買入	▲200		▲100			
社債等買入	▲300					
ETF買入		+1,700		+500		
被災地金融機関支援					▲900	+2,300
国債補完供給	+700	▲300	+300			
当座預金増減		+16,400		▲8,200		+400
当座預金残高		3,776,700		3,768,500		3,768,900
準備預金残高		3,351,000				
積み終了先		3,350,900				
超過準備		3,350,900				
非準備先残高		425,700				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		90.3%				
乖離率		9.6%				

### 主な需給要因

源泉税揚げ

### 6月12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(6/14~6/21)					2.380	2.380
CP等買入(6/15~)	2,500	6,233	2,485	▲0.007	▲0.002	27.0
国債補完供給(6/12~6/13)	49,585	135	135	▲0.600	▲0.600	
	1,000	210	210	▲0.600	▲0.600	

### マネタリーベース [億円]

6月11日時点 4,842,200

### 所要

今積期の所要準備額 3,123,100

6月13日以降の残り所要	積数	平均
	400	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	第765回
6月22日	3ヶ月	
6月29日	3ヶ月	

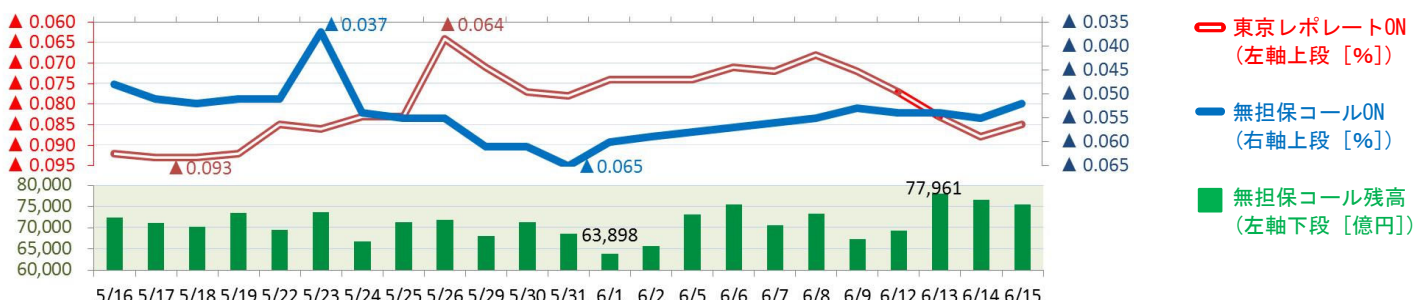
### 今月の国債買入オペ予定

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	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	22	27	29	6月6日	4
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,300	4	6	13	20	22	29	6月6日	4
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,300	1	6	14	20	27	6月8日	3	
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,900	4	8	14	20	27	6月1日	1	
25年超	500~1,500 程度	700						6月8日	0	
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。 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