

### 短期市場の推移

[億円] [%]

	6月13日	6月14日	6月15日	6月18日
加重平均金利	▲0.068	▲0.067	▲0.064	▲0.069
東京レポレート(ON)	▲0.082	▲0.084	▲0.106	▲0.097
無コール残	68,986	84,640	85,086	63,464
ON	40,766	51,140	52,746	34,964
その他	28,220	33,500	32,340	28,500
有コール残	28,461	31,668	24,450	23,014

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20日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 政策委員会・金融政策決定会合議事要旨(4月26・27日分)	-	21:30 (米)1-3月期経常収支	-1290億米ドル
-	-	23:00 (米)5月中古住宅販売件数	558万件
-	-	-	-

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
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.086	0.001	▲0.070	▲0.099
T/N	-	-	0.000	▲0.111
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.040	▲0.126
2W	-	-	0.080	▲0.152
3W	-	-	-	▲0.146
1M	-	-	-	▲0.145
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.143
6M	-	-	-	▲0.150
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。その後は主に、▲0.086%~▲0.050%の水準で取引される軟調な地合となった。同加重平均金利(速報)は、前日比▲0.001%の▲0.070%となった。

### O/N業態別合出レンジ

[%]

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

明日もビッドが薄く、軟調な地合が継続する見込み。本日と同様に、▲0.086%~▲0.050%の水準で取引されると予想。

### 資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月19日	6月20日	6月20日	6月21日	6月21日	6月22日
券	▲500	▲900	▲900	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	+1,500	+59,100	+59,100	+2,000	+2,000	+2,000
過不足	+1,000	+58,200	+58,200	+3,000	+3,000	+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
国庫短期証券買入		+7,500				
CP等買入	▲200		▲600			
社債等買入	▲300		▲1,100			
国債補完供給	+100	▲800	+800			
貸出増加支援			▲19,700	+17,600		
当座預金増減		+7,300	+55,200	▲3,000		
当座預金残高	3,878,000	3,933,200	3,933,200	3,930,200		
準備預金残高	3,416,200					
積み終了先	3,400,900					
超過準備	3,395,600					
非準備預金残高	461,800					
準備預金進捗率	98.9%					
平均	13.3%					
乖離率	85.5%					

### 6月19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 接分

### 米ドル資金供給(6/21~6/28)

2.410 2.410

### 社債等買入(6/25~)

1,750 4,007 1,750 ▲0.194 ▲0.120 50.9

### 国債補完供給(6/19~6/20)

96,120 774 ▲0.600 ▲0.600

19,895 12 ▲0.600 ▲0.600

### マナタリーベース [億円]

所要

[億円]

6月18日時点 4,954,200

今積期の所要準備額 3,017,200

6月20日以降の残り所要

積数 33,700

平均 1,300

### 国庫短期証券入札予定

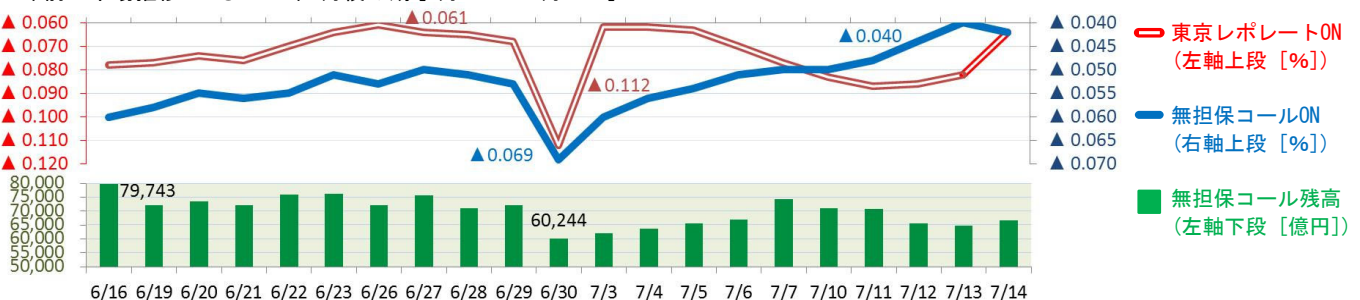
6月22日	3ヶ月	第766回
6月29日	3ヶ月	
7月6日	3ヶ月	
7月9日	6ヶ月	
6月21日	5年	
6月26日	20年	
6月28日	2年	
7月3日	10年	

### 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			
			月2回程度							
1年以下	100~1,000 程度	500				6月13日	0			
1年超3年以下	2,000~3,000 程度	2,500				6月14日	3			
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,000	4	6	14	22	27	29	6月14日	3
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,300	1	6	13	20	22	29	6月13日	3
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,900							6月14日	2
25年超	500~1,500 程度	700	4	8	14	20	27		6月13日	0
物価連動債	250 程度	250	月2回程度			6月13日	0			
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6月積み期 [6月16日~7月14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。