



### 短期市場の推移

	[億円] [%]			
	6月1日	6月2日	6月3日	6月4日
加重平均金利	▲0.038	▲0.043	▲0.037	▲0.034
東京レポレート(TN)	▲0.092	▲0.085	▲0.085	▲0.076
無コール残	140,661	130,922	123,979	131,800
ON	85,748	75,859	69,028	76,519
その他	54,913	55,063	54,951	55,281
有コール残	22,460	20,142	19,109	20,680

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	0.001	▲0.032	▲0.069
T/N	▲0.020	▲0.001	▲0.007	▲0.072
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.020	▲0.025	▲0.077
2W	-	-	▲0.030	▲0.082
3W	-	-	-	▲0.087
1M	-	-	-	▲0.093
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.115
1Y	-	-	-	▲0.134

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8日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	GDP改定値 (1-3月)	▲4.9%	18:00	(欧) 1-Q GDP 確定値 (1-3月)	-1.8%
8:50	4月 国際収支 (経常収支)	1兆4,900億円	21:30	(米) 4月 貿易収支	-681億ドル
8:50	4月 貿易収支	3,427億円	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.030%の合出から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.015%で合出が見られた。積み終盤に入り、ビッドサイドの調達ニーズは強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.032%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.040	▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.045 ~ ▲0.015

### 翌営業日のマーケット

堅調な地合は継続すると思われ、出合水準は本日対比小幅上昇を予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月7日		6月8日		6月9日	
券	+700		+500		+0	
財政	▲1,100		+600		▲12,000	
過不足	▲400		+1,100		▲12,000	
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
共通担保(全店)					▲3,400	
CP等買入	▲100		▲100			
国債補完供給	+100	▲200	+200			
当座預金増減	▲600		+1,200		▲15,400	
当座預金残高	5,182,600		5,183,800		5,168,400	
準備預金残高	4,570,700		主な需給要因			
積み終了先	4,570,700		国債発行 (30年)			
超過準備	4,570,700					
非準備先残高	611,900					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	74.2%					
乖離率	25.7%					

### 6月7日のオペ結果

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

社債等買入(6/10~)  
 1,250 2,263 1,252 ▲0.057 ▲0.050 90.4

### 国債補完供給(6/7~6/8)

186 186 ▲0.350 ▲0.350  
 0 0

マネタリーベース [億円]  
 6月4日時点 6,392,100

所要 [億円]  
 今積期の所要準備額 3,750,800  
 6月8日以降の残り所要  
 積数 100  
 平均 0

### 国債短期証券入札予定

6月9日	6ヶ月(第999回)
6月11日	3ヶ月(第1000回)
6月15日	6ヶ月
6月16日	1年

### 国債入札予定

6月8日	30年
6月22日	5年
6月24日	20年
6月29日	2年

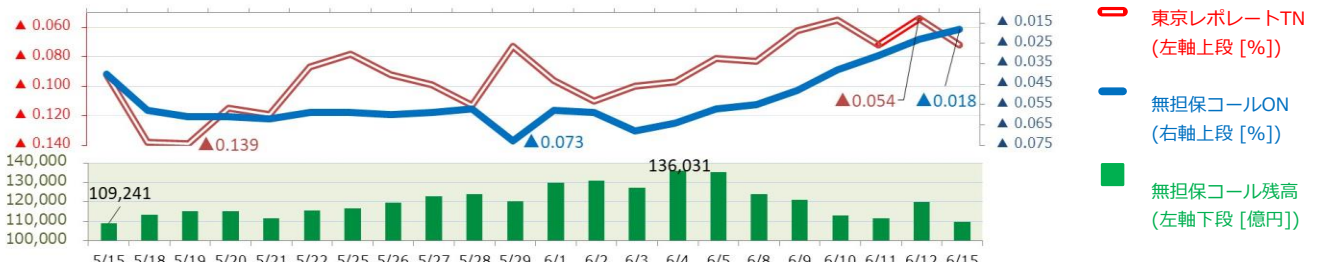
### 今月の国債買入オペ予定

オベ種類	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回程度	5月28日	1
1年超3年以下	4750	4,750	2 9 16 23	6月2日	3
3年超5年以下	4500	4,500	2 9 16 28	6月2日	3
5年超10年以下	4500	4,500	9 16 23 28	5月28日	4
10年超25年以下	2000	2,000	2	6月2日	0
25年超	500	500	28	5月20日	1
物価連動債	600	600	月1回程度	5月28日	1
変動利付債<四半期>	300	300	-	4月21日	-

### 1年前の市場推移

○2020年5月積み期 [5月15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