



### 短期市場の推移

	6月2日	6月3日	6月4日	6月7日
加重平均金利	▲0.043	▲0.037	▲0.034	▲0.032
東京レポレート(TN)	▲0.085	▲0.085	▲0.076	▲0.072
無コール残	130,922	123,979	131,800	114,013
ON	75,859	69,028	76,519	59,470
その他	55,063	54,951	55,281	54,543
有コール残	20,142	19,109	20,680	20,445

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	▲0.060	0.001	▲0.029	▲0.064
T/N	▲0.015	▲0.001	▲0.003	▲0.070
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.030	▲0.075
2W	▲0.010	▲0.009	▲0.010	▲0.080
3W	-	-	-	▲0.086
1M	-	-	▲0.009	▲0.092
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.114
1Y	-	-	-	▲0.133

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9日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
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

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.025%の合出から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.010%で合出が見られた。昨日に引き続き資金調達ニーズは強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.003%の▲0.029%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.050 ~ ▲0.010

### 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8日		6月9日		6月10日	
券	+500		+100		▲1,000	
財政	+6,500		▲12,800		+3,000	
過不足	+7,000		▲12,700		+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
国庫短期証券買入				+15,000		
共通担保(全店)			▲3,400	+3,400		
CP等買入	▲100		▲100			
社債等買入			▲100			+1,300
国債補充供給	+200					
当座預金増減	+7,100		+2,100		+3,300	
当座預金残高	5,189,700		5,191,800		5,195,100	
準備預金残高	4,588,100		主な需給要因			
積み終了先	4,588,100		国債発行(30年)		国庫短期証券	
超過準備	4,588,100				発行償還(6M)	
非準備先残高	601,600					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	77.4%					
乖離率	22.5%					

### 6月8日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(6/9~)	15,000	37,545	15,000	0.007	0.007	
米ドル資金供給(6/10~6/17)	0	0	0.310	0.310		
米ドル資金供給(6/10~9/2)	0	0	0.330	0.330		
国債補充供給(6/8~6/9)	4	4	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(6/9~6/23)	20,000	3,351	3,351			

マネタリーベース (億円)  
6月7日時点 6,390,800

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,750,800
6月9日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

### 国庫短期証券入札予定

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(第1001回)
6月16日	1年

### 国債入札予定

6月22日	5年
6月24日	20年
6月29日	2年
7月1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
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