



短期市場の推移

	6月4日	6月7日	6月8日	6月9日
加重平均金利	▲0.034	▲0.032	▲0.029	▲0.026
東京レボレート(TN)	▲0.076	▲0.072	▲0.070	▲0.065
無コール残	131,800	114,013	121,665	115,406
ON	76,519	59,470	65,702	60,043
その他	55,281	54,543	55,963	55,363
有コール残	20,680	20,445	19,405	19,933

加重平均金利、コール残高は日銀、東京レボ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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.050	0.001	▲0.022	▲0.064
T/N	▲0.012	▲0.001	▲0.005	▲0.074
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.015	▲0.005	▲0.012	▲0.075
2W	-	-	▲0.040	▲0.080
3W	-	-	-	▲0.087
1M	0.013	0.100	0.046	▲0.093
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.101
6M	-	-	-	▲0.113
1Y	-	-	-	▲0.133

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

6月11日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
特になし		G7サミット (13日まで)	
-		(米)6月ミシガン大消費者信頼感 (速報)	
-		-	

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▲0.020%の割合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.010%で出が見られた。前営業日よりも調達ニーズがやや強まり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.004%の▲0.022%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.030	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.030 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

積み期最後の3日積みとなるため調達ニーズが強まり、出水準は本日対比上昇を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月10日	6月11日	6月11日	6月14日	6月14日	6月14日
券	▲400	+200	+200	+0	+0	+0
財政	▲6,300	▲2,300	▲2,300	▲8,000	▲8,000	▲8,000
過不足	▲6,700	▲2,100	▲2,100	▲8,000	▲8,000	▲8,000
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		+14,600				
CP等買入	▲300		▲900			
社債等買入		+1,300				
被災地金融機関支援			▲500	+600		
国債補充供給		▲200	+200			
新型コロナ対応金融支援特別			▲200			
当座預金増減		+8,700	▲2,900	▲8,000	▲8,000	▲8,000
当座預金残高		5,201,100	5,198,200	5,190,200	5,190,200	5,190,200
準備預金残高		4,585,000				
積み終了先		4,585,000				
超過準備		4,585,000				
非準備先残高		616,100				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		83.9%				
乖離率		16.1%				

6月10日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(6/10~6/11)	157	157	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース (億円)
6月9日時点 6,400,000

所要	所要
今積期の所要準備額	3,750,800
6月11日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

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(第1002回)
6月17日	3ヶ月(第1003回)
6月22日	5年
6月24日	20年
6月29日	2年
7月1日	10年

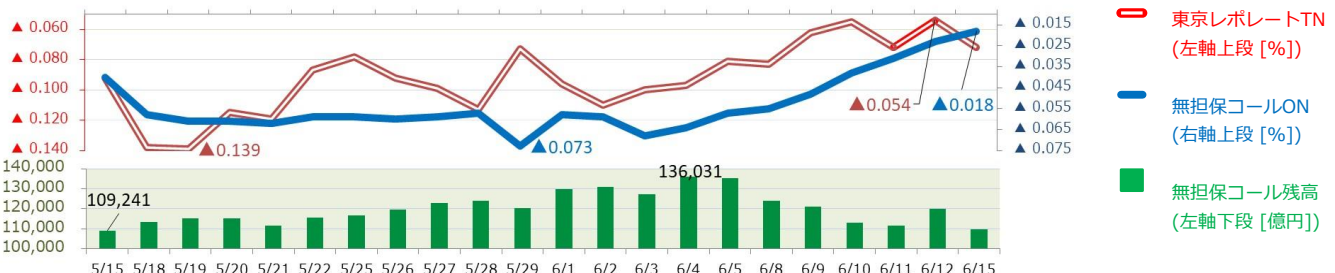
今月の国債買入オペ予定

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9日	2
3年超5年以下	4500	4,500	2 9 16 28	6月9日	2
5年超10年以下	4500	4,500	9 16 23 28	6月9日	3
10年超25年以下	2000	2,000	2 28	6月2日	0
25年超	500	500		5月20日	1
物価連動債	600	600	月1回程度	6月9日	0
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