



短期市場の推移

	6月8日	6月9日	6月10日	6月11日
加重平均金利	▲0.029	▲0.026	▲0.022	▲0.016
東京レポレート(TN)	▲0.070	▲0.065	▲0.074	▲0.073
無コール残	121,665	115,406	125,553	127,467
ON	65,702	60,043	64,960	68,194
その他	55,963	55,363	60,593	59,273
有コール残	19,405	19,933	19,461	19,385

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	▲0.050	0.001	▲0.015	▲0.071
T/N	-	-	▲0.001	▲0.081
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.015	0.150	0.004	▲0.083
2W	▲0.030	0.050	▲0.002	▲0.085
3W	-	-	-	▲0.092
1M	-	-	-	▲0.097
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.103
6M	-	-	-	▲0.115
1Y	-	-	-	▲0.132

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15日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 (米) 5月の小売売上高	-0.4%
-	-	21:30 (米) 5月の生産者物価コア指数 (前年比)	4.8%
-	-	-	-

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%の合出から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.010%で合出が見られた。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+0.001%の▲0.015%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.020	▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.025 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

積み最終日であり資金調達ニーズも強いいため、堅調な地合が予想される。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月14日	6月15日	6月14日	6月15日	6月14日	6月15日
券	▲200			+100		+0
財政	+1,600			+79,100		▲18,000
過不足		+1,400		+79,200		▲18,000
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	▲300		▲600			
国債補完供給	+500	▲300	+300			
当座預金増減		+1,300		+86,400		▲18,000
当座預金残高		5,199,100		5,285,500		5,267,500
準備預金残高		4,622,500		4,622,500		4,622,500
積み終了先		4,622,500		年定時払い		国庫短期証券
超過準備		4,622,500		国債発行償還		発行償還(6M)
非準備先残高		576,600		(個人向け)		
準備預金進捗率		100.0%				
平均		96.8%				
乖離率		3.2%				

6月14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(6/15~)	7,500	21,698	7,500	0.001	0.002	76.6
CP等買入(6/17~)	5,000	9,926	4,991	▲0.006	▲0.004	13.8
国債補完供給(6/14~6/15)	315	315	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
6月11日時点 6,405,700

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,750,800
6月15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25日	3ヶ月

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	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	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