



### 短期市場の推移

	6月10日	6月11日	6月14日	6月15日
加重平均金利	▲0.022	▲0.016	▲0.015	▲0.013
東京レボレート(TN)	▲0.074	▲0.073	▲0.081	▲0.086
無コール残	125,553	127,467	120,397	127,507
ON	64,960	68,194	67,874	78,344
その他	60,593	59,273	52,523	49,163
有コール残	19,461	19,385	20,130	18,975

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	▲0.080	0.001	▲0.034	▲0.081
T/N	-	-	▲0.001	▲0.085
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.017	▲0.007	▲0.012	▲0.085
2W	▲0.037	▲0.004	▲0.013	▲0.089
3W	-	-	-	▲0.093
1M	▲0.005	0.001	▲0.003	▲0.097
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.102
6M	-	-	-	▲0.114
1Y	-	-	-	▲0.132

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17日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀金融政策決定会合 (1日目)		(米)週間新規失業保険申請件数	
-		(欧)5月消費者物価(確報)	
-		-	

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%の出合から始まり、その後は主に▲0.065%~▲0.015%で出合が見られた。積み期初営業日のため調達ニーズが前営業日に比べ弱く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.021%の▲0.034%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.060	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.040 ~ ▲0.015

### 翌営業日のマーケット

調達ニーズは本日と同程度で、出合いの水準は本日対比横ばいを予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	6月16日	6月17日	6月17日	6月18日	6月18日
券	▲300	▲1,200	▲1,200	▲1,000	▲1,000
財政	▲12,500	+3,800	+3,800	+15,000	+15,000
過不足	▲12,800	+2,600	+2,600	+14,000	+14,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入				+14,000	
CP等買入	▲400			+5,000	
社債等買入	▲100		▲100		
国債補充供給	+100				
貸出増加支援				▲26,400	+26,500
当座預金増減	▲13,200	+21,500	+21,500	+14,100	+14,100
当座預金残高	5,274,500	5,296,000	5,296,000	5,310,100	5,310,100
準備預金残高	4,632,900				
積み終了先	3,297,700				
超過準備	1,378,400				
非準備預金残高	641,600				
準備預金進捗率	89.6%				
平均	3.3%				
乖離率	86.3%				

### 6月16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	按分
------	------	----	----	----	----	----

国債買入(6/17~)						
1~3年	4,750	15,425	4,755	0.004	0.004	72.8
3~5年	4,500	9,811	4,505	0.002	0.003	47.2
5~10年	4,500	11,852	4,511	0.005	0.006	1.9

国債補充供給(6/16~6/17)						
1	1	▲0.350	▲0.350			
0	0					

貸出増加を支援するための資金供給(6/18~)	26,498	26,498				
-------------------------	--------	--------	--	--	--	--

マネタリーベース	【億円】
6月15日時点	6,495,600

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,632,600
6月17日以降の残り所要	
積数	378,200
平均	13,000

### 国庫短期証券入札予定

6月17日	3ヶ月(第1003回)
6月25日	3ヶ月
7月2日	3ヶ月
7月8日	6ヶ月
6月22日	5年
6月24日	20年
6月29日	2年
7月1日	10年

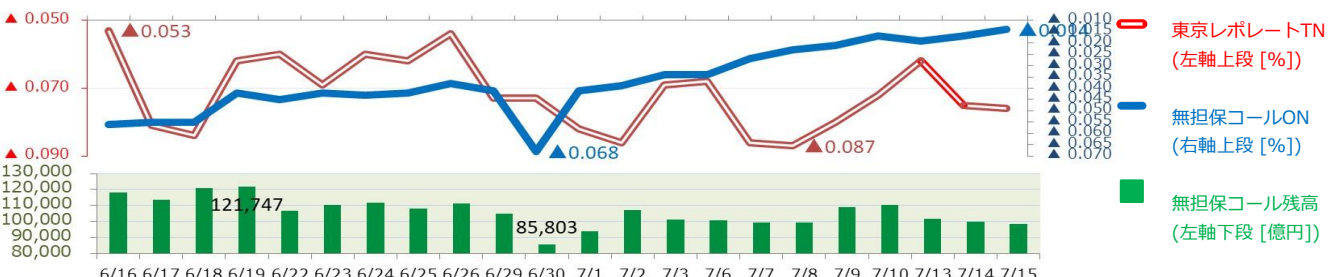
### 今月の国債買入オペ予定

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16日	1
3年超5年以下	4500	4,500	2 9 16 28	6月16日	1
5年超10年以下	4500	4,500	9 16 23 28	6月16日	2
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6月積み期 [6月16日~7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