



### 短期市場の推移

	6月11日	6月14日	6月15日	6月16日
加重平均金利	▲0.016	▲0.015	▲0.013	▲0.034
東京レボレート(TN)	▲0.073	▲0.081	▲0.086	▲0.085
無コール残	127,467	120,397	127,507	135,412
ON	68,194	67,874	78,344	80,441
その他	59,273	52,523	49,163	54,971
有コール残	19,385	20,130	18,975	20,812

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	▲0.065	0.001	▲0.028	▲0.082
T/N	▲0.012	▲0.001	▲0.003	▲0.084
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.020	▲0.010	▲0.015	▲0.086
2W	-	-	-	▲0.089
3W	-	-	0.002	▲0.091
1M	-	-	-	▲0.095
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.011	▲0.101
6M	-	-	-	▲0.114
1Y	-	-	-	▲0.131

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18日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
-	政策委員会・金融政策決定会合の決定内容	-	-	-
8:30	消費者物価コア指数(5月)	▲0.1%	-	-
-	-	-	-	-

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%の割合から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.015%で割合が見られた。ビッドサイドの一部が調達に積極的な姿勢を見せ、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.006%の▲0.028%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.050	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.040 ~ ▲0.015

### 翌営業日のマーケット

週末3日積みにより、出合いの水準は本日対比若干の上昇を予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	6月17日	6月18日	6月18日	6月21日	6月21日
券	▲1,200	▲500	▲500	+0	+0
財政	+4,400	+9,200	+9,200	+50,000	+50,000
過不足	+3,200	+8,700	+8,700	+50,000	+50,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	スタート
国債買入		+14,000			
CP等買入		+5,000	▲400		
社債等買入	▲100		▲800		
国債補充供給		▲600	+600		
貸出増加支援			▲24,100	+26,500	
当座預金増減		+21,500	+10,500	+50,000	
当座預金残高		5,296,000	5,306,500	5,356,500	
準備預金残高		4,649,300	主な需給要因		
積み終了先		4,623,200	国庫短期証券発行償還 (3M・1Y)		
超過準備		4,290,100	国債償還(5年・10年・20年)		
非準備先残高		646,700			
準備預金進捗率		99.5%			
平均		6.7%			
乖離率		92.8%			

### 6月17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(6/17~6/18)	559	559	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)  
6月16日時点 6,482,800

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,632,600
6月18日以降の残り所要	
積数	19,000
平均	700

### 国庫短期証券入札予定

6月25日	3ヶ月
7月2日	3ヶ月
7月8日	6ヶ月
7月9日	3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

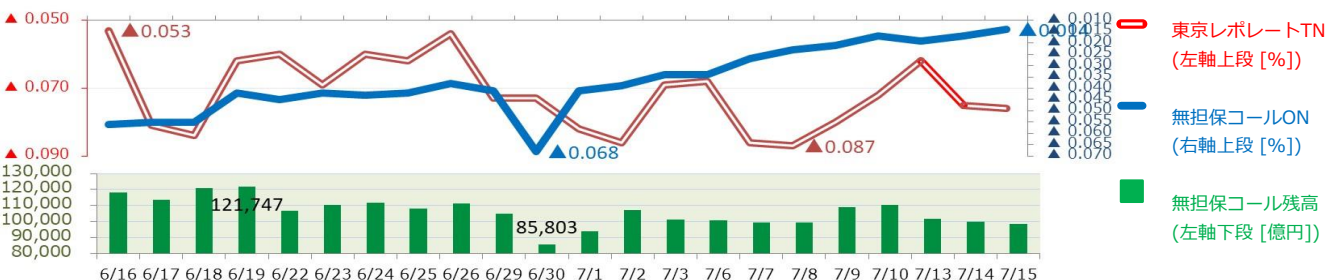
### 今月の国債買入オペ予定

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