



短期市場の推移

[億円] [%]

	6月15日	6月16日	6月17日	6月18日
加重平均金利	▲0.013	▲0.034	▲0.028	▲0.027
東京レボレート(TN)	▲0.086	▲0.085	▲0.084	▲0.084
無コール残	127,507	135,412	142,787	153,350
ON	78,344	80,441	87,096	94,279
その他	49,163	54,971	55,691	59,071
有コール残	18,975	20,812	20,044	19,918

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	▲0.065	0.001	▲0.026	▲0.083
T/N	▲0.012	▲0.001	▲0.003	▲0.086
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.035	▲0.015	▲0.032	▲0.085
2W	-	-	▲0.030	▲0.091
3W	-	-	-	▲0.091
1M	-	-	-	▲0.095
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.011	▲0.101
6M	-	-	-	▲0.113
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

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	6月21日	6月22日	6月23日
券	▲400	▲400	▲1,000
財政	+46,400	▲100	▲27,000
過不足	+46,000	▲500	▲28,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+12,500
共通担保(全店)			▲3,400
CP等買入	▲500	▲200	
国債補完供給	+100	▲200	+200
当座預金増減	+45,400	+12,000	▲31,400
当座預金残高	5,353,500	5,365,500	5,334,100
準備預金残高	4,684,400		
積み終了先	4,683,900		
超過準備	4,683,900		
非準備先残高	669,100		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	20.0%		
乖離率	79.9%		

6月21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
国庫短期証券買入(6/22~)	12,500	49,582	12,505	0.003	0.004	27.8
社債等買入(6/24~)	750	2,326	751	0.093	0.105	14.3
国債補完供給(6/21~6/22)	183	183	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース [億円]
6月18日時点 6,518,100

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,632,600
6月22日以降の残り所要	
積数	4,300
平均	200

国庫短期証券入札予定

6月25日	3ヶ月(第1004回)
7月2日	3ヶ月
7月8日	6ヶ月
7月9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

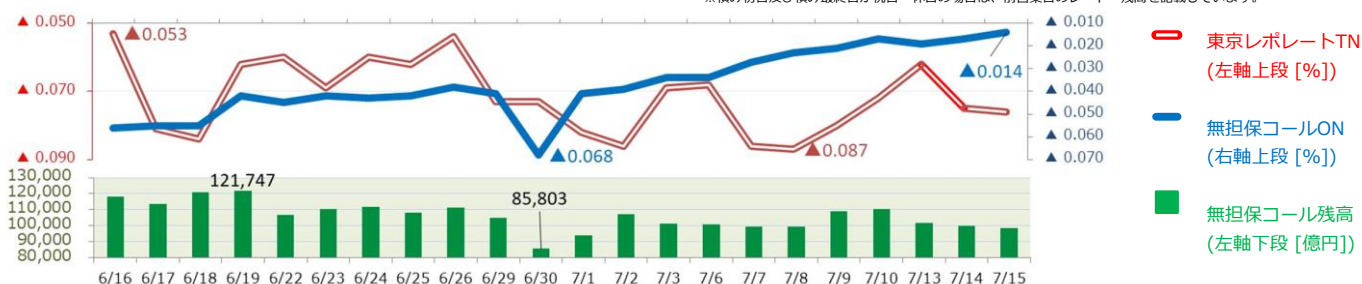
今月の国債買入オペ予定

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