



短期市場の推移

	6月16日	6月17日	6月18日	6月21日
加重平均金利	▲0.034	▲0.028	▲0.027	▲0.026
東京レボレート(TN)	▲0.085	▲0.084	▲0.084	▲0.086
無コール残	135,412	142,787	153,350	141,708
ON	80,441	87,096	94,279	81,517
その他	54,971	55,691	59,071	60,191
有コール残	20,812	20,044	19,918	20,373

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	▲0.060 0.001 ▲0.029	▲0.084
T/N	▲0.012 ▲0.001 ▲0.003	▲0.086
S/N	- - ▲0.015	-
1W	▲0.025 ▲0.002 ▲0.013	▲0.086
2W	- - -	▲0.090
3W	- - -	▲0.091
1M	- - -	▲0.095
2M	- - -	▲0.101
3M	- - -	▲0.102
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

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	6月22日	6月23日	6月24日
券	▲400	▲900	▲2,000
財政	+1,600	▲27,000	+5,000
過不足	+1,200	▲27,900	+3,000
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	+12,500		
共通担保(全店)		▲3,400	+3,800
CP等買入	▲200	▲700	
社債等買入			+800
国債補充供給	+200		
当座預金増減	+13,700	▲28,200	+3,800
当座預金残高	5,367,200	5,339,000	5,342,800
準備預金残高	4,711,000	主な需給要因	
積み終了先	4,710,500		
超過準備	4,710,500		
非準備先残高	656,200		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	23.3%	国債発行(5年)	
乖離率	76.6%		

6月22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
米ドル資金供給(6/24~7/1)	0	0	0.350	0.350		
米ドル資金供給(6/24~9/16)	0	0	0.350	0.350		
国債補充供給(6/22~6/23)	0	0				
共通担保(全店)(6/23~7/7)	20,000	3,751	3,751			

マネタリーベース [億円]

6月21日時点 6,563,900

所要

今積期の所要準備額	3,632,600
6月23日以降の残り所要	
積数	3,800
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24日	20年
6月29日	2年
7月1日	10年
7月6日	30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	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