



短期市場の推移

	6月17日	6月18日	6月21日	6月22日
加重平均金利	▲0.028	▲0.027	▲0.026	▲0.029
東京レボレート(TN)	▲0.084	▲0.084	▲0.086	▲0.086
無コール残	142,787	153,350	141,708	153,576
ON	87,096	94,279	81,517	92,955
その他	55,691	59,071	60,191	60,621
有コール残	20,044	19,918	20,373	20,216

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	▲0.070	0.001	▲0.028	▲0.083
T/N	▲0.012	▲0.001	▲0.003	▲0.085
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.040	▲0.007	▲0.025	▲0.088
2W	-	-	▲0.015	▲0.091
3W	-	-	-	▲0.091
1M	-	-	-	▲0.095
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲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

6月24日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
15:45	【挨拶】黒田総裁(信用金庫法制定70周年記念全国大会)	21:30	(米)週間新規失業保険申請件数 41.2%
		21:30	(米)国内総生産(GDP)確定値(前期比年率) 6.4%
			(欧)EU首脳会議(25日まで)

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▲0.050%~▲0.015%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.028%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.040	▲0.040 - ▲0.040	▲0.045 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

調達サイドの動向は変わらず、出合の水準は本日対比で横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	6月23日	6月24日	6月23日	6月24日	6月25日
券	▲900	▲1,700	▲900	▲1,700	▲1,000
財政	▲24,800	+1,300	▲24,800	+1,300	▲8,000
過不足	▲25,700	▲400	▲25,700	▲400	▲9,000
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				+11,000	
共通担保(全店)	▲3,400	+3,800			
CP等買入	▲700		▲500		
社債等買入				+800	
新型コロナ対応金融支援特別					▲99,700
当座預金増減	▲26,000	+10,900	▲26,000	+10,900	▲108,700
当座預金残高	5,341,200	5,352,100	5,341,200	5,352,100	5,243,400
準備預金残高	4,678,000		4,678,000		主な需給要因
積み終了先	4,677,700		4,677,700		
超過準備	4,677,600		4,677,600		
非準備先残高	663,200		663,200		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		国債発行(20年)
平均	26.7%		26.7%		
乖離率	73.2%		73.2%		

6月23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(6/24~)						
~1年	1,500	2,567	1,503	0.000	0.004	36.2
1~3年	4,750	16,534	4,759	0.002	0.004	14.5
5~10年	4,500	14,438	4,513	0.000	0.001	41.8

国債補完供給(6/23~6/24)

	0	0
	0	0

マナリーベース (億円)
6月22日時点 6,578,000

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,632,600
6月24日以降の残り所要	
積数	3,300
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
6月24日	20年
6月29日	2年
7月1日	10年
7月6日	30年

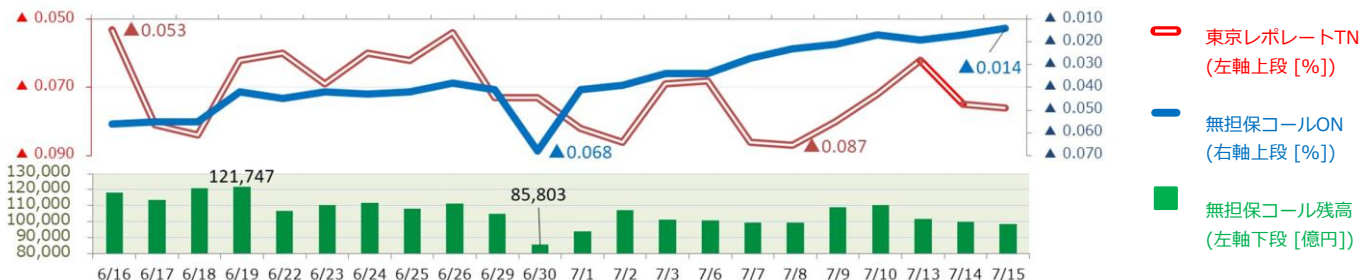
今月の国債買入オペ予定

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	6月23日	0
1年超3年以下	4750	4,750	2 9 16 23	6月23日	0
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23日	1
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