



### 短期市場の推移

	6月18日	6月21日	6月22日	6月23日
加重平均金利	▲0.027	▲0.026	▲0.029	▲0.028
東京レポレート(TN)	▲0.084	▲0.086	▲0.086	▲0.085
無コール残	153,350	141,708	153,576	141,330
ON	94,279	81,517	92,955	79,239
その他	59,071	60,191	60,621	62,091
有コール残	19,918	20,373	20,216	21,258

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポ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)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.065	0.001	▲0.028	▲0.081
T/N	▲0.015	▲0.001	▲0.005	▲0.086
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	-	-	▲0.025	▲0.088
2W	-	-	-	▲0.090
3W	-	-	-	▲0.091
1M	-	-	-	▲0.095
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.101
6M	-	-	-	▲0.112
1Y	-	-	-	▲0.130

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

### 6月25日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	8:50	資金循環統計(速報) (1~3月期)	-	21:30 (米)5月個人消費支出(PCE) 価格コア指数[前年比]
	-	-	-	-
	-	-	-	-

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)は前営業日対比横ばいの▲0.028%となった。

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

### 翌営業日のマーケット

出合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24日	6月25日	6月24日	6月25日	6月28日	6月29日
券	▲1,700	▲1,000	▲1,000	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	+500	+900	+900	+900	+5,000	+5,000
過不足	▲1,200	▲1,900	▲1,900	▲1,900	+5,000	+5,000
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
国債買入		+11,000				
CP等買入	▲500		▲900			
社債等買入		+800	▲200			
新型コロナ対応金融支援特別			▲99,700	+107,800		
当座預金増減	+10,100	+5,100	+5,100	+5,100	+5,000	+5,000
当座預金残高	5,351,300	5,356,400	5,356,400	5,361,400	5,361,400	5,361,400
準備預金残高	4,685,200					
積み終了先	4,684,900					
超過準備	4,684,900					
非準備先残高	666,100					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	30.0%					
乖離率	69.9%					

### 6月24日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(6/24~6/25)	4	4	▲0.350	▲0.350		
新型コロナ対応金融支援特別(6/25~12/27)	107,752	107,752				

マナタリベース	所要
6月23日時点 6,552,900	今積期の所要準備額 3,632,600
	6月25日以降の残り所要積数 3,000
	平均 100

### 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

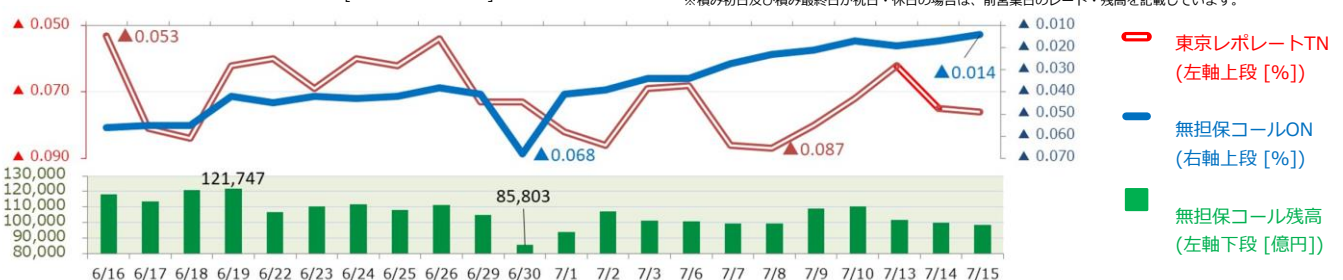
### 今月の国債買入オペ予定

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	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