



短期市場の推移

	6月20日	6月21日	6月22日	6月23日
加重平均金利	▲0.044	▲0.046	▲0.047	▲0.047
東京レボレート(TN)	▲0.114	▲0.110	▲0.114	▲0.191
無コール残	143,721	141,621	141,894	138,575
ON	68,658	65,563	64,256	60,597
その他	75,063	76,058	77,638	77,978
有コール残	25,686	25,488	29,117	26,133

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	▲0.080	0.001	▲0.040	▲0.100
T/N	-	-	▲0.028	▲0.108
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.182
2W	-	-	-	▲0.165
3W	-	-	-	▲0.158
1M	-	-	-	▲0.154
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.144
6M	-	-	-	▲0.135
1Y	-	-	-	▲0.127

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27日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
金融政策決定会合における主な意見[6/16・17日分]			
-		-	
-		-	

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▲0.040%の割合から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.025%の水準で取引された。週末3日積みでビッドサイドの調達意欲の強まりも見られ、本日の無担保コールON物加重平均金利(速報)は前日比+0.007%の▲0.040%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.053	- ~ -	▲0.048 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

3日積み要因の剥落により、出合いの水準は本日対比で若干の低下を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月24日	6月27日	6月27日	6月28日	6月28日	6月28日
券	▲700	▲300	▲300	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲200	▲3,800	▲3,800	+3,000	+3,000	+3,000
過不足	▲900	▲4,100	▲4,100	+2,000	+2,000	+2,000
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
CP等買入	▲700		▲100			
社債等買入	▲400		+1,000			
国債補完供給	+31,900	▲22,800	+22,800			
新型コロナ対応金融支援特別					▲124,700	
当座預金増減	+7,100	+19,600	+19,600	▲122,700	▲122,700	▲122,700
当座預金残高	5,632,500	5,652,100	5,652,100	5,529,400	5,529,400	5,529,400
準備預金残高	4,955,300					
積み終了先	4,954,900					
超過準備	4,954,900					
非準備先残高	677,200					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	36.7%					
乖離率	63.2%					

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
国債買入(固定利回り方式)(6/27~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(6/24~6/27)						
	22,185	22,185	▲0.450	▲0.450		
	650	650	▲0.450	▲0.450		

マナタリーベース 【億円】
6月23日時点 6,873,800

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,743,800
6月27日以降の残り所要	
積数	2,000
平均	100

国庫短期証券入札予定

7月1日	3ヶ月(第1091回)
7月7日	6ヶ月
7月8日	3ヶ月
7月15日	3ヶ月
6月28日	2年
7月5日	10年
7月7日	30年
7月12日	5年

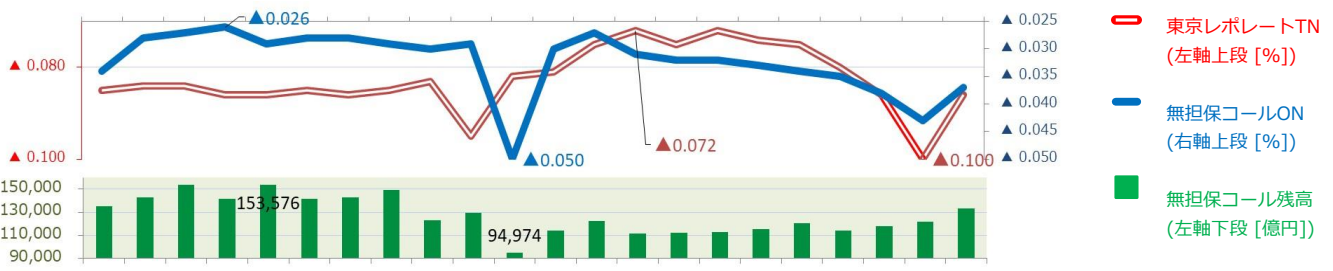
今月の国債買入オペ予定

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	6月3日	0
1年超3年以下	4750	4,750	3 8 15 22	6月22日	0
3年超5年以下	4750	6,250	3 8 15 29	6月15日	1
5年超10年以下	5000	5,000	8 15 22 29	6月22日	1
10年超25年以下	1250	2,500	8 15 29	6月15日	1
25年超	500	500	3 15 22	6月22日	0
物価連動債	600	600	月1回	5月30日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	4月8日	-

1年前の市場推移

○2021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