



短期市場の推移

	6月1日	6月2日	6月3日	6月6日
加重平均金利	▲0.029	▲0.034	▲0.039	▲0.043
東京レポレート(TN)	▲0.089	▲0.087	▲0.085	▲0.084
無コール残	165,589	164,028	142,132	128,504
ON	84,736	80,965	64,889	52,041
その他	80,853	83,063	77,243	76,463
有コール残	29,542	29,708	29,705	30,264

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	▲0.070	0.001	▲0.045	▲0.083
T/N	▲0.045	▲0.009	▲0.035	▲0.083
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	-	-	▲0.030	▲0.089
2W	▲0.040	▲0.008	▲0.032	▲0.094
3W	-	-	-	▲0.101
1M	-	-	-	▲0.109
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.111
6M	-	-	-	▲0.112
1Y	-	-	-	▲0.112

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8日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	1-3月期国内総生産 (GDP)改定値 [前期比年率]	▲1.1%	18:00	(欧)1-3月期域内総生産 (GDP)確定値[前年比]	5.1%
8:50	4月国際収支(経常収支)	4989億円		-	

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%の出合から始まり、その後は主に▲0.055%~▲0.038%の水準で取引された。ビッドサイドの調達ニーズは限定的であり、レートを切り下げて調達する動きが見られたため同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.045%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.060	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.065 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

オファービッド共に大きな動向変化はなく、出合いの水準は本日対比横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月7日	6月8日	6月8日	6月9日	6月9日	6月9日
券	+700		+600		▲1,000	
財政	+4,000		▲5,600		+0	
過不足	+4,700		▲5,000		▲1,000	
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				+5,000		
国債買入				+900		
共通担保(全店)			▲5,300	+4,000		
CP等買入			▲200			
国債補充供給	+2,400	▲1,900	+1,900			
当座預金増減	+5,200		+1,300		▲1,000	
当座預金残高	5,384,500		5,385,800		5,384,800	
準備預金残高	4,723,100					
積み終了先	4,723,100					
超過準備	4,723,100					
非準備先残高	661,400					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	74.2%					
乖離率	25.7%					

6月7日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(6/8~)	5,000	22,167	5,000	0.011	0.013	
国債買入(固定利回り方式)(6/8~)						
5~10年	934	934				
米ドル資金供給(6/9~6/16)	0	0	1,080	1,080		
国債補充供給(6/7~6/8)	1,868	1,868	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(6/8~6/22)	20,000	3,950	3,950			

マネタリーベース [億円] 所要
 6月6日時点 6,623,600

今積期の所要準備額 3,871,700
 6月8日以降の残り所要
 積数 100
 平均 0

国庫短期証券入札予定

6月9日	6ヶ月(第1085回)
6月10日	3ヶ月(第1086回)
6月14日	6ヶ月(第1087回)
6月15日	1年

国債入札予定

6月21日	5年
6月23日	20年
6月28日	2年
7月5日	10年

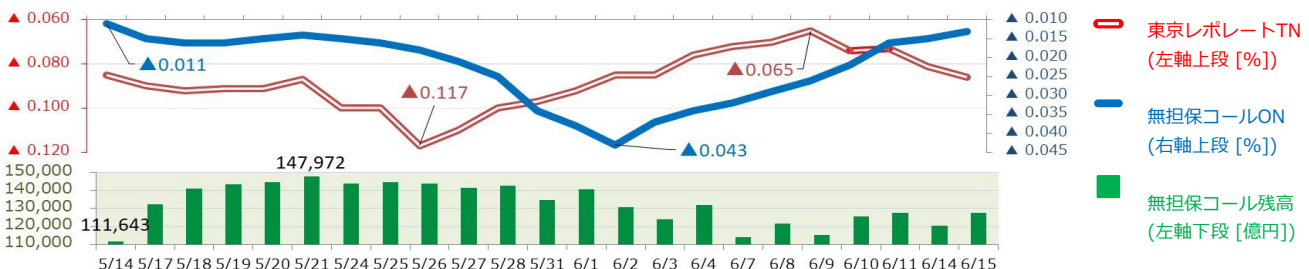
今月の国債買入オペ予定

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	6月3日	-
1年超3年以下	4750	4,750	3 8 15 22	6月3日	3
3年超5年以下	4750	4,750	3 8 15 29	6月3日	3
5年超10年以下	5000	5,000	8 15 22 29	5月30日	4
10年超25年以下	1250	1,250	8 29	5月25日	2
25年超	500	500	3 22	6月3日	1
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5月積み期 [5月14日~6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