



短期市場の推移

	6月2日	6月3日	6月6日	6月7日
加重平均金利	▲0.034	▲0.039	▲0.043	▲0.045
東京レポレート(TN)	▲0.087	▲0.085	▲0.084	▲0.083
無コール残	164,028	142,132	128,504	130,747
ON	80,965	64,889	52,041	53,564
その他	83,063	77,243	76,463	77,183
有コール残	29,708	29,705	30,264	29,667

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	▲0.075	0.001	▲0.041	▲0.086
T/N	▲0.048	▲0.009	▲0.037	▲0.086
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	-	-	0.000	▲0.089
2W	-	-	▲0.010	▲0.094
3W	-	-	▲0.033	▲0.100
1M	-	-	-	▲0.107
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9日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	20:45 (欧)6月欧中銀 (ECB) 政策金利 ECB総裁の会見	0.0%
-	-	21:30 (米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
-	-	-	-

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%の合出から始まり、その後は主に▲0.070%~▲0.035%の水準で取引された。一部オファーサイドのニーズ減退があり、レートを切り上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+0.004%の▲0.041%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.060	▲0.055 ~ ▲0.040	▲0.060 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

引き続き資金調達ニーズは堅調だと思われ、横ばいの地合を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月8日	6月9日	6月9日	6月10日	6月10日	6月10日
券	+500		▲800		+0	
財政	▲9,000		▲3,900		▲4,000	
過不足	▲8,500		▲4,700		▲4,000	
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		+16,000		
共通担保(全店)	▲5,300	+4,000				
CP等買入	▲200		▲100			
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+1,900	▲1,700	+1,700			
当座預金増減	▲3,900		+12,800		▲4,000	
当座預金残高	5,380,600		5,393,400		5,389,400	
準備預金残高	4,726,800		主な需給要因			
積み終了先	4,726,800		国庫短期証券発行・償還			
超過準備	4,726,800		(6M)			
非準備先残高	653,800		流動性供給			
準備預金進捗率	99.9%					
平均	77.4%					
乖離率	22.5%					

6月8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)(6/9~)						
5~10年	0	0				
国債買入(6/9~)						
1~3年	4,750	12,207	4,756	▲0.002	▲0.001	73.3
3~5年	4,750	9,406	4,755	▲0.010	▲0.008	10.2
5~10年	5,000	11,162	5,004	▲0.006	▲0.005	59.9
10~25年	1,250	3,738	1,256	▲0.005	▲0.004	81.1
国債補完供給(6/8~6/9)						
	1,661	1,661	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
6月7日時点 6,628,200

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,871,700
6月9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	3ヶ月(第1087回)
6月15日	1年(第1088回)

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

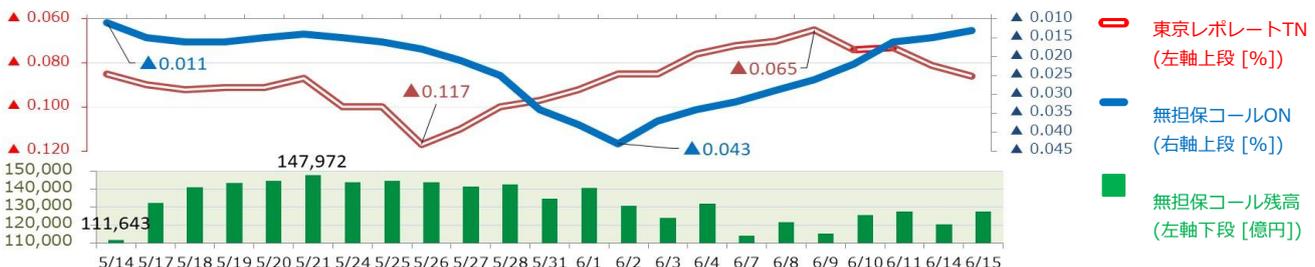
今月の国債買入オペ予定

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	0
1年超3年以下	4750	4,750	3 8 15 22	6月8日	2
3年超5年以下	4750	4,750	3 8 15 29	6月8日	2
5年超10年以下	5000	5,000	8 15 22 29	6月8日	3
10年超25年以下	1250	1,250	8 29	6月8日	1
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	0

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