



短期市場の推移

[億円] [%]

	6月3日	6月6日	6月7日	6月8日
加重平均金利	▲0.039	▲0.043	▲0.045	▲0.041
東京レボレート(TN)	▲0.085	▲0.084	▲0.083	▲0.086
無コール残	142,132	128,504	130,747	129,663
ON	64,889	52,041	53,564	52,770
その他	77,243	76,463	77,183	76,893
有コール残	29,705	30,264	29,667	29,619

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	▲0.065	0.001	▲0.029	▲0.087
T/N	-	-	-	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.000	▲0.036	▲0.089
2W	-	-	-	▲0.094
3W	▲0.045	▲0.025	▲0.035	▲0.101
1M	-	-	-	▲0.107
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.111
6M	-	-	-	▲0.112
1Y	-	-	-	▲0.112

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	6月9日	6月10日	6月13日
券	▲700	+100	+0
財政	▲4,100	+2,900	▲14,000
過不足	▲4,800	+3,000	▲14,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+16,000	+100	スタート
CP等買入	▲100		
社債等買入	▲100		
国債補完供給	+1,700	▲3,000	+3,000
当座預金増減	+9,700	+6,100	▲14,000
当座預金残高	5,390,300	5,396,400	5,382,400
準備預金残高	4,718,700		
積み終了先	4,718,700		
超過準備	4,718,700		
非準備先残高	671,600		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	80.6%		
乖離率	19.3%		

6月9日のオペ結果

[%][億円]※ミ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(固定利回り方式)(6/10~)						
5~10年	60	60				
CP等買入(6/14~)						
	4,000	8,201	3,965	▲0.001	0.005	53.8
国債補完供給(6/9~6/10)						
	2,960	2,960	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

6月8日時点 6,623,700

所要

[億円]

今積期の所要準備額	3,871,700
6月10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10日	3ヶ月(第1086回)
6月14日	6ヶ月(第1087回)
6月15日	1年(第1088回)
6月16日	3ヶ月(第1089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

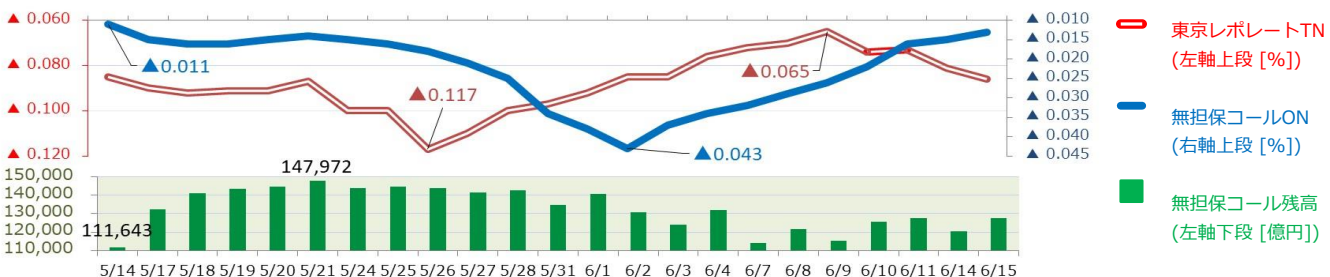
今月の国債買入オペ予定

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