



短期市場の推移

	6月6日	6月7日	6月8日	6月9日
加重平均金利	▲0.043	▲0.045	▲0.041	▲0.029
東京レポレート(TN)	▲0.084	▲0.083	▲0.086	▲0.086
無コール残	128,504	130,747	129,663	156,821
ON	52,041	53,564	52,770	79,728
その他	76,463	77,183	76,893	77,093
有コール残	30,264	29,667	29,619	29,815

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	▲0.080	0.001	▲0.025	▲0.086
T/N	-	-	▲0.010	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.089
2W	-	-	-	▲0.094
3W	-	-	-	▲0.103
1M	-	-	0.010	▲0.108
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13日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想

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

3日積みとなる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▲0.035%~▲0.018%の水準で取引された。前営業日同様、資金調達ニーズの高まりから取り上がる動きが見られ、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.004%の▲0.025%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.045 ~ ▲0.035	▲0.035 ~ ▲0.018

翌営業日のマーケット

3日積み要因が剥落するとともに、今積み期の資金繰りに目途を付けたビッドサイドが調達を控える動きも想定されるため、出合の水準は本日対比低下を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	6月10日		6月13日		6月14日
券	+100		+100		+0
財政	+100		▲8,500		+2,000
過不足	+200		▲8,400		+2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入		+100		+900	
CP等買入			▲400		+4,000
社債等買入			▲300		
国債補完供給	+3,000	▲3,700	+3,700		
当座預金増減	▲400		▲4,500		+6,000
当座預金残高	5,389,900		5,385,400		5,391,400
準備預金残高	4,714,300		4,714,200		4,714,200
積み終了先	4,714,200		4,714,200		4,714,200
超過準備	4,714,200		4,714,200		4,714,200
非準備先残高	675,600		675,600		675,600
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%
平均	90.3%		90.3%		90.3%
乖離率	9.7%		9.7%		9.7%

6月10日のオペ結果

[%][億円] ※米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)(6/13~)						
5~10年	880	880				
国債補完供給(6/10~6/13)						
	3,709	3,709	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
6月9日時点 6,634,100

所要	今積み期の所要準備額
6月13日以降の残り所要	3,871,700
積数	0
平均	0

国債短期証券入札予定

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)
6月24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	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