



デイリーシグナル

2022年6月13日(月)

短期市場の推移

	6月7日	6月8日	6月9日	6月10日
加重平均金利	▲0.045	▲0.041	▲0.029	▲0.025
東京レボレート(TN)	▲0.083	▲0.086	▲0.086	▲0.086
無コール残	130,747	129,663	156,821	152,855
ON	53,564	52,770	79,728	77,912
その他	77,183	76,893	77,093	74,943
有コール残	29,667	29,619	29,815	30,753

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	▲0.070	0.001	▲0.033	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.035	▲0.090
2W	0.010	0.100	0.045	▲0.094
3W	-	-	-	▲0.103
1M	-	-	-	▲0.108
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.040	▲0.112
6M	-	-	-	▲0.111
1Y	-	-	-	▲0.111

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14日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
13:30	4月鉱工業生産・確報		21:30	(米)5月生産者物価コア指数 [前年比]	8.5%
	-			(米) FOMC(15日まで)	
	-			-	

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▲0.025%の割合から始まり、その後は主に▲0.035%~▲0.025%の水準で取引された。3日積み要因剥落、積み期終盤を迎え、資金調達ニーズの減退が見られ、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.008%の▲0.033%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.025	- ~ -	▲0.035 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

今積み期終盤に入り、ビッドサイドの調達量減少が想定されるため、軟調な出合水準が継続すると予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	6月13日	6月14日	6月14日	6月15日	6月15日
券		+100		▲200	▲1,000
財政		▲9,800		+6,400	+67,000
過不足		▲9,700		+6,200	+66,000
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		+900		+15,200	
CP等買入	▲400		▲400	+4,000	
社債等買入	▲300				
E T F 買入				+700	
国債補充供給	+3,700	▲4,000	+4,000		
当座預金増減		▲9,800		+29,700	+66,000
当座預金残高		5,380,100		5,409,800	5,475,800
準備預金残高		4,741,500	主な需給要因		
積み終了先		4,741,500			年金定時払い
超過準備		4,741,500			流動性供給
非準備先残高		638,600			個人向け国債
準備預金進捗率		100.0%			発行・償還
平均乖離率		93.5%			
		6.5%			

6月13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)(6/14~)						
5~10年	15,337	15,337				
国債補充供給(6/13~6/14)						
	3,960	3,960	▲0.350	▲0.350		
	71	71	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)
 6月10日時点 6,633,600

所要	所要
今積期の所要準備額	3,871,700
6月14日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

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
6月21日	5年
6月23日	20年
6月28日	2年
7月5日	10年

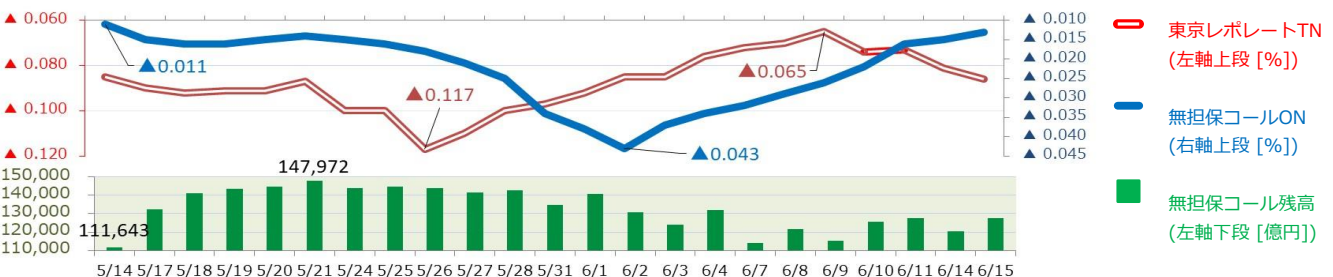
今月の国債買入オペ予定

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