



短期市場の推移

	6月8日	6月9日	6月10日	6月13日
加重平均金利	▲0.041	▲0.029	▲0.025	▲0.033
東京レボレート(TN)	▲0.086	▲0.086	▲0.086	▲0.085
無コール残	129,663	156,821	152,855	136,378
ON	52,770	79,728	77,912	62,505
その他	76,893	77,093	74,943	73,873
有コール残	29,619	29,815	30,753	30,537

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	▲0.034	▲0.087
T/N	-	-	-	▲0.091
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.020	▲0.029	▲0.094
2W	▲0.045	0.045	▲0.023	▲0.097
3W	-	-	-	▲0.104
1M	-	-	-	▲0.109
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.111
6M	-	-	-	▲0.111
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

6月15日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	18:00	(欧)4月貿易収支
-	-	21:30	(米)5月小売売上高
-	-	-	(米)FOMC パウエルFRB議長記者会見

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▲0.035%の出合から始まり、その後は主に▲0.035%~▲0.025%の水準で取引された。ビッドサイドの一部で調達量を抑制する動きも見られ、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.034%となった。なお日銀の国債買入オペ(固定利回り方式)の落札額は過去最高の22,126億円となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.050	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.040 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

積み期最終日となる明日は、着地に向けた調達需要の強まりから出合水準は上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月14日		6月15日		6月16日	
券	▲200		▲400		▲1,000	
財政	+3,800		+72,100		+3,000	
過不足	+3,600		+71,700		+2,000	
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
国債買入	+15,200		+31,800			
CP等買入	▲400	+4,000	▲500			
社債等買入			▲100			
E T F買入	+700					
国債補充供給	+4,000	▲4,700	+4,700			
当座預金増減	+22,400		+107,600		+2,000	
当座預金残高	5,402,500		5,510,100		5,512,100	
準備預金残高	4,735,000		4,735,000		4,735,000	
積み終了先	4,735,000		年金定時払い		国庫短期証券	
超過準備	4,735,000		流動性供給		発行・償還(6M)	
非準備先残高	667,500		個人向け国債発行・償還			
準備預金進捗率	100.0%					
平均乖離率	96.8%					
	3.2%					

6月14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)(6/15~)						
5~10年	22,126	22,126				
国債買入(6/15~)						
5~10年	8,000	8,116	8,000	▲0.029	0.029	68.0
10~25年	1,000	3,429	1,001	0.015	0.025	100.0
25年~	500	1,438	502	0.005	0.021	92.0
米ドル資金供給(6/16~6/23)						
1	1	1,680	1,680			
国債補充供給(6/14~6/15)						
3,612	3,612	▲0.350	▲0.352			
1,151	1,151	▲0.350	▲0.350			

マネタリーベース 【億円】
6月13日時点 6,623,700

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,871,700
6月15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15日	1年(第1088回)
6月16日	3ヶ月(第1089回)
6月24日	3ヶ月
7月1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

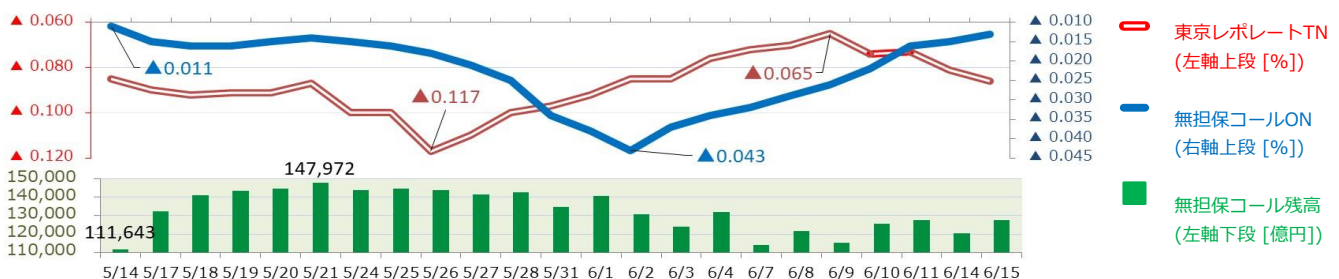
今月の国債買入オペ予定

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	6250	4,750	3 8 15 22	6月8日	2
3年超5年以下	6250	4,750	3 8 15 29	6月8日	2
5年超10年以下	8000	8,000	8 15 22 29	6月14日	3
10年超25年以下	2500	1,000	8 15 29	6月14日	2
25年超	1500	500	3 15 22	6月14日	2
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