



短期市場の推移

	6月15日	6月16日	6月17日	6月20日
加重平均金利	▲0.023	▲0.042	▲0.040	▲0.044
東京レポレート(TN)	▲0.100	▲0.151	▲0.162	▲0.114
無コール残	139,011	138,634	147,246	143,721
ON	67,893	68,041	74,083	68,658
その他	71,118	70,593	73,163	75,063
有コール残	29,782	29,866	29,781	25,686

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	▲0.046	▲0.137
T/N	-	-	▲0.030	▲0.110
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.038	0.280	▲0.012	▲0.131
2W	-	-	-	▲0.140
3W	-	-	-	▲0.141
1M	▲0.040	▲0.025	▲0.036	▲0.142
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.130
6M	-	-	-	▲0.123
1Y	-	-	-	▲0.118

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22日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀金融政策決定会合 議事要旨 (4月27~28日開催分)		(米)パウエルFRB議長の 議会証言 (上院)	
-		-	
-		-	

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%の割合から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.035%の水準で取引された。ビッドサイドの資金ニーズ減退により出合いの水準は低下し、本日の無担保コールON物加重平均は前日比▲0.002%の▲0.046%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.055	- ~ -	▲0.055 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

本日対比幅ばい圏での出合を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月21日		6月22日		6月23日	
券	▲500		▲800		▲1,000	
財政	+3,300		▲27,200		+3,000	
過不足	+2,800		▲28,000		+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
国庫短期証券買入	+1,000					
共通担保(全店)			▲4,000		+4,500	
CP等買入	▲400		▲300			
社債等買入			▲100			
国債補充供給	+32,700	▲29,700	+29,700			
当座預金増減	+6,400		+1,800		+2,000	
当座預金残高	5,650,000		5,651,800		5,653,800	
準備預金残高	4,964,500		主な需給要因			
積み終了先	4,963,400		国債発行(5年)			
超過準備	4,963,300					
非準備先残高	685,500					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	20.0%					
乖離率	79.9%					

6月21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)(6/22~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(6/23~6/30)						
	0	0	1,840	1,840		
国債補充供給(6/21~6/22)						
	28,975	28,975	▲0.350	▲0.350		
	700	700	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(6/22~7/6)						
	20,000	4,450	4,450			

マネタリーベース [億円]
6月20日時点 6,889,200

所要	今積期の所要準備額
6月22日以降の残り所要	3,743,800
積数	4,300
平均	200

国庫短期証券入札予定

6月24日	3ヶ月(第1090回)
7月1日	3ヶ月
7月7日	6ヶ月
7月8日	3ヶ月

国債入札予定

6月23日	20年
6月28日	2年
7月5日	10年
7月7日	30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	6,250	3 8 15 22	6月15日	1
3年超5年以下	4750	6,250	3 8 15 29	6月15日	1
5年超10年以下	5000	8,000	8 15 22 29	6月15日	2
10年超25年以下	1250	2,500	8 15 29	6月15日	1
25年超	500	1,500	3 15 22	6月15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	-

1年前の市場推移

○2021年6月積み期 [6月16日~7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