



## デイリーシグナル

2022年6月27日(月)

### 短期市場の推移

	6月21日	6月22日	6月23日	6月24日
加重平均金利	▲0.046	▲0.047	▲0.047	▲0.040
東京レボレート(TN)	▲0.110	▲0.114	▲0.191	▲0.108
無コール残	141,621	141,894	138,575	140,165
ON	65,563	64,256	60,597	61,877
その他	76,058	77,638	77,978	78,288
有コール残	25,488	29,117	26,133	29,016

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	▲0.075	0.001	▲0.040	▲0.087
T/N	-	-	▲0.027	▲0.090
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.167
2W	-	-	-	▲0.154
3W	-	-	0.005	▲0.153
1M	-	-	-	▲0.147
2M	-	-	-	-
3M	0.020	0.045	0.022	▲0.142
6M	-	-	-	▲0.134
1Y	-	-	-	▲0.130

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28日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)4月S&P/コアロジック CS20都市住宅 価格指数[前年比]	21.2%
-	-	(米)6月消費者信頼感指数	100.0
-	-	-	-

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▲0.040%の合出から始まり、その後は主に▲0.055%~▲0.030%の水準で取引された。先週末対比で出合水準に大きな変化はなく、無担保コールON物加重平均金利(速報)は前日対比横ばいの▲0.040%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.050 ~ ▲0.030

### 翌営業日のマーケット

ビッドサイドの動向に変化はなく、本日対比で横ばいを予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月27日	6月28日	6月28日	6月29日	6月29日	6月29日
券	▲300	▲300	▲300	▲300	▲300	+0
財政	▲1,400	+700	+700	+700	+700	+3,000
過不足	▲1,700	▲1,700	+400	+400	+400	+3,000
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
CP等買入	▲100	+1,000	▲500			
社債等買入						
国債補完供給	+22,800	▲20,200	+20,200			
新型コロナ対応金融支援特別			▲124,700	+11,900		
当座預金増減	+1,800	+1,800	▲92,700	▲92,700	▲92,700	+3,000
当座預金残高	5,634,300	5,634,300	5,541,600	5,541,600	5,544,600	5,544,600
準備預金残高	4,960,100	4,960,100	4,960,100	4,960,100	4,960,100	4,960,100
積み終了先	4,959,700	4,959,700	4,959,700	4,959,700	4,959,700	4,959,700
超過準備	4,959,700	4,959,700	4,959,700	4,959,700	4,959,700	4,959,700
非準備先残高	674,200	674,200	674,200	674,200	674,200	674,200
準備預金進捗率	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%
平均	40.0%	40.0%	40.0%	40.0%	40.0%	40.0%
乖離率	59.9%	59.9%	59.9%	59.9%	59.9%	59.9%

### 6月27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)(6/28~)						
5~10年	0	0	0			
5~10年	0	0	0			
CP等買入(6/30~)						
	4,000	11,781	3,984	▲0.001	0.009	17.5
国債補完供給(6/27~6/28)						
	19,057	19,057	▲0.350	▲0.350		
	1,096	1,096	▲0.350	▲0.350		
新型コロナ対応金融支援特別(6/28~12/23)						
	11,924	11,924				

マネタリーベース [億円]  
6月24日時点 6,881,600

所要	今積期の所要準備額
6月28日以降の残り所要	3,743,800
積数	1,600
平均	100

### 国債短期証券入札予定

7月1日	3ヶ月(第1091回)
7月7日	6ヶ月
7月8日	3ヶ月
7月15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22日	0
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	5,000	8 15 22 29	6月22日	1
10年超25年以下	1250	2,500	8 15 29	6月15日	1
25年超	500	500	3 15 22	6月22日	0
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