



### 短期市場の推移

	6月22日	6月23日	6月24日	6月27日
加重平均金利	▲0.047	▲0.047	▲0.040	▲0.040
東京レポレート(TN)	▲0.114	▲0.191	▲0.108	▲0.090
無コール残	141,894	138,575	140,165	134,522
ON	64,256	60,597	61,877	56,464
その他	77,638	77,978	78,288	78,058
有コール残	29,117	26,133	29,016	28,940

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	▲0.075	0.001	▲0.039	▲0.087
T/N	-	-	▲0.025	▲0.090
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.015	0.001	▲0.011	▲0.157
2W	-	-	-	▲0.154
3W	-	-	-	▲0.148
1M	-	-	-	▲0.145
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.005	▲0.139
6M	-	-	-	▲0.133
1Y	-	-	-	▲0.129

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29日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
特になし			21:30	(米)1-3月期国内総生産(GDP)確定値[前期比年率]	-1.4%
-				-	
-				-	

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%の合出から始まり、その後は主に▲0.055%~▲0.025%の水準で取引された。地銀業態の一部に昨日よりも取りあがる動きが見られたが、無担保コールON物加重平均金利(速報)は前日対比+0.001%に留まり、▲0.039%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.050	▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.040 ~ ▲0.025

### 翌営業日のマーケット

市場残高が減少傾向にあるため、出合水準は本日対比で横ばいからやや上昇を予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月28日		6月29日		6月30日	
券	▲300		▲600		▲700	
財政	▲100		▲1,200		+1,300	
過不足	▲400		▲1,800		+600	
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		
国債買入				+1,400		
CP等買入	▲500		▲1,200			+4,000
ETF買入				+500		
国債補充供給	+20,200	▲17,500	+17,500			
新型コロナ対応金融支援特別	▲124,700	+11,900				
当座預金増減	▲111,000		+17,400		+4,600	
当座預金残高	5,523,300		5,540,700		5,545,300	
準備預金残高	4,860,000		主な需給要因			
積み終了先	4,859,600					
超過準備	4,859,600					
非準備先残高	663,300					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	43.3%					
乖離率	56.6%					

### 6月28日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(6/29~)	1,000	7,450	1,000	0.026	0.026	
国債買入(固定利回り方式)(6/29~)						
5~10年	1,375	1,375				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(6/30~7/7)	0	0	1,840	1,840		
国債補充供給(6/28~6/29)	16,878	16,878	▲0.350	▲0.350		
	650	650	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)  
6月27日時点 6,883,600

所要	今積期の所要準備額
6月29日以降の残り所要	3,743,800
積数	1,100
平均	100

### 国庫短期証券入札予定

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
物価運動債	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	-

### 国債入札予定

7月5日	10年
7月7日	30年
7月12日	5年
7月14日	20年

### 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