



短期市場の推移

	6月23日	6月24日	6月27日	6月28日
加重平均金利	▲0.047	▲0.040	▲0.040	▲0.039
東京レポレート(TN)	▲0.191	▲0.108	▲0.090	▲0.090
無コール残	138,575	140,165	134,522	133,677
ON	60,597	61,877	56,464	55,739
その他	77,978	78,288	78,058	77,938
有コール残	26,133	29,016	28,940	29,934

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	▲0.065	0.001	▲0.033	▲0.093
T/N	-	-	▲0.020	▲0.326
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.005	▲0.026	▲0.164
2W	▲0.045	▲0.001	▲0.030	▲0.154
3W	▲0.035	0.000	▲0.028	▲0.151
1M	▲0.040	0.002	▲0.024	▲0.146
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲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30日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	5月鉱工業生産指数[前月比]	▲0.1%	15:00	(英)1-3月期国内総生産(GDP)改定値[前年比]	8.7%
			21:30	(米)5月個人消費支出(PCE)価格コア指数[前年比]	4.8%

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▲0.040%~▲0.020%の水準で取引された。ビッドサイドが積極的な調達姿勢となったことで、無担保コールON物加重平均金利(速報)は前日対比+0.006%の▲0.033%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.038 ~ ▲0.035	▲0.033 ~ ▲0.033	▲0.035 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

翌営業日は四半期末となるため調達を控える先もあり、出合いの水準は本日対比低下すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月29日	6月30日	6月30日	7月1日	7月1日	7月1日
券	▲600	▲900	▲900	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲2,400	+6,200	+6,200	▲22,600	▲22,600	▲22,600
過不足	▲3,000	+5,300	+5,300	▲23,600	▲23,600	▲23,600
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		+12,100		
国債買入		+1,400				
CP等買入	▲1,200		▲4,800	+4,000		
E T F 買入		+500				
国債補充供給	+17,500	▲18,700	+18,700			
当座預金増減	▲2,500	+35,300	+35,300	▲23,600	▲23,600	▲23,600
当座預金残高	5,520,800	5,556,100	5,556,100	5,532,500	5,532,500	5,532,500
準備預金残高	4,848,500	主な需給要因				
積み終了先	4,848,100	国債発行・償還(2年)				
超過準備	4,848,100					
非準備先残高	672,300					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	46.7%					
乖離率	53.2%					

6月29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)(6/30~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(6/30~)						
3~5年	4,750	8,894	4,755	▲0.006	▲0.004	78.1
5~10年	5,000	10,008	5,006	▲0.005	▲0.004	82.9
10~25年	1,250	4,188	1,261	0.001	0.002	23.8
物価連動	600	2,075	601	▲0.400	▲0.461	73.6
国債補充供給(6/29~6/30)						
	18,025	18,025	▲0.350	▲0.350		
	650	650	▲0.350	▲0.350		

マナターベース	所要
6月28日時点	6,772,900
今積期の所要準備額	3,743,800
6月30日以降の残り所要	
積数	800
平均	0

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
7月5日	10年
7月7日	30年
7月12日	5年
7月14日	20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	1,500	1,500	月1回	6月3日	0
1年超3年以下	4,750	4,750	3 8 15 22	6月22日	0
3年超5年以下	4,750	4,750	3 8 15 29	6月29日	0
5年超10年以下	5,000	5,000	8 15 22 29	6月29日	0
10年超25年以下	1,250	1,250	8 15 29	6月29日	0
25年超	500	500	3 15 22	6月22日	0
物価連動債	600	600	月1回	6月29日	0
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