



短期市場の推移

	6月24日	6月27日	6月28日	6月29日
加重平均金利	▲0.040	▲0.040	▲0.039	▲0.033
東京レポレート(TN)	▲0.108	▲0.090	▲0.090	▲0.326
無コール残	140,165	134,522	133,677	135,062
ON	61,877	56,464	55,739	58,287
その他	78,288	78,058	77,938	76,775
有コール残	29,016	28,940	29,934	28,387

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	▲0.040	▲0.233
T/N	-	-	▲0.020	▲0.139
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.043	0.010	▲0.021	▲0.139
2W	▲0.038	▲0.014	▲0.031	▲0.139
3W	-	-	-	▲0.141
1M	▲0.030	0.100	▲0.016	▲0.137
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.136
6M	-	-	-	▲0.131
1Y	-	-	-	▲0.128

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

7月1日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	5月有効求人倍率	1.24倍	18:00	(欧)6月消費者物価コア指数[前年比]
8:30	5月失業率	+2.5%	23:00	(米)6月ISM製造業景況指数
8:50	4-6月期日銀短観(大企業製造業DI)	13	-	55.5

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。ビッドサイドの一部では四半期末の取引を控える先もあり、無担保コールON物加重平均金利(速報)は前日対比▲0.007%の▲0.040%となった。

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

翌営業日のマーケット

四半期末で取引を控えていたビッドサイドが調達を再開し、合出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30日	7月1日	7月1日	7月4日	7月4日
券	▲900		▲200		+1,000
財政	+5,500		▲16,100		▲42,700
過不足		+4,600		▲16,300	▲41,700
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入		+12,100			
CP等買入	▲4,800	+4,000			
社債等買入			▲100		
国債補完供給	+18,700	▲32,300	+32,300		
当座預金増減		+2,300		+15,900	▲41,700
当座預金残高		5,523,100		5,539,000	5,497,300
準備預金残高		4,856,400			
積み終了先		4,855,900			
超過準備		4,855,900			
非準備先残高		666,700			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		50.0%			
乖離率		49.9%			

6月30日のオペ結果

オベ種類 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)(7/1~)	5~10年	0	0
5~10年	0	0	
5~10年	0	0	
国債補完供給(6/30~7/1)	32,248	32,248	▲0.550 ▲0.550
	0	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(第1092回)
7月8日	3ヶ月
7月15日	3ヶ月

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

来月の国債買入オペ予定

オベ種類	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	7月1日	6月3日	1
1年超3年以下	4750	4,750	6 13 19 25	6月22日	4
3年超5年以下	4750	4,750	6 19 25 29	6月29日	4
5年超10年以下	5000	5,000	13 19 25 29	6月29日	4
10年超25年以下	1250	1,250	6 25	6月29日	2
25年超	500	500	13 29	6月22日	2
物価運動債	600	600	7月1日	6月29日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	4月8日	1

マネタリーベース

6月29日時点 6,771,000

所要

今積期の所要準備額	3,743,800
7月1日以降の残り所要	
積数	300
平均	0

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