



### 短期市場の推移

	5月31日	6月1日	6月2日	6月5日
加重平均金利	▲0.071	▲0.070	▲0.072	▲0.068
東京レボレート(TN)	▲0.126	▲0.141	▲0.116	▲0.102
無コール残	159,567	165,556	166,029	155,047
ON	91,524	89,193	85,846	75,644
その他	68,043	76,363	80,183	79,403
有コール残	24,158	22,986	24,727	26,424

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	▲0.087	0.001	▲0.058	▲0.096
T/N	-	-	-	▲0.100
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.065	▲0.025	▲0.057	▲0.131
2W	-	-	▲0.060	▲0.138
3W	-	-	0.001	▲0.151
1M	-	-	-	▲0.172
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.164
6M	-	-	-	▲0.134
1Y	-	-	-	▲0.102

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7日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
15:00	コール市場残高		-	
	-		-	
	-		-	

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.065%の合出から始まり、その後は主に▲0.065%~▲0.050%の水準で取引された。ビットサイドの調達意欲が強まり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.010%の▲0.058%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.060	▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.070 ~ ▲0.050

### 翌営業日のマーケット

ビットサイドの調達意欲は引き続き強く、出合い水準は本日対比上昇すると予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	6月6日	6月7日	6月7日	6月8日	6月8日
券	+1,100	+0	+0	▲1,000	▲1,000
財政	▲5,300	▲11,500	▲11,500	+1,000	+1,000
過不足	▲4,200	▲11,500	▲11,500	+0	+0
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+1,000		
共通担保(全店)			▲7,700	+8,000	
CP等買入	▲400				
社債等買入	▲400				
国債補充供給	+34,100	▲30,500	+30,500		
当座預金増減	▲1,400	+20,300	+20,300	+0	+0
当座預金残高	5,342,900	5,363,200	5,363,200	5,363,200	5,363,200
準備預金残高	4,675,400	4,674,900	4,674,900	4,674,900	4,674,900
積み終了先	4,674,900	4,674,900	4,674,900	4,674,900	4,674,900
超過準備	4,674,900	4,674,900	4,674,900	4,674,900	4,674,900
非準備先残高	667,500	667,500	667,500	667,500	667,500
準備預金進捗率	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%
平均	71.0%	71.0%	71.0%	71.0%	71.0%
乖離率	28.9%	28.9%	28.9%	28.9%	28.9%

### 6月6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(6/7~)	1,000	5,467	1,001	0.002	0.003	23.6
国債買入(固定利回り方式)(6/7~)	5~10年	0	0			
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(6/8~6/15)	0	0	5,330	5,330		
国債補充供給(6/6~6/7)	30,565	30,565	▲0.350	▲0.350		
5	5	▲0.350	▲0.350			
共通担保(全店)(6/7~6/21)	8,011	8,011				

マナトリーベース	所要
6月5日時点	6,601,100

所要	所要
今積期の所要準備額	4,008,700
6月7日以降の残り所要	
積数	2,200
平均	200

### 国庫短期証券入札予定

6月8日	6ヶ月(第1161回)
6月9日	3ヶ月(第1162回)
6月15日	3ヶ月
6月19日	1年

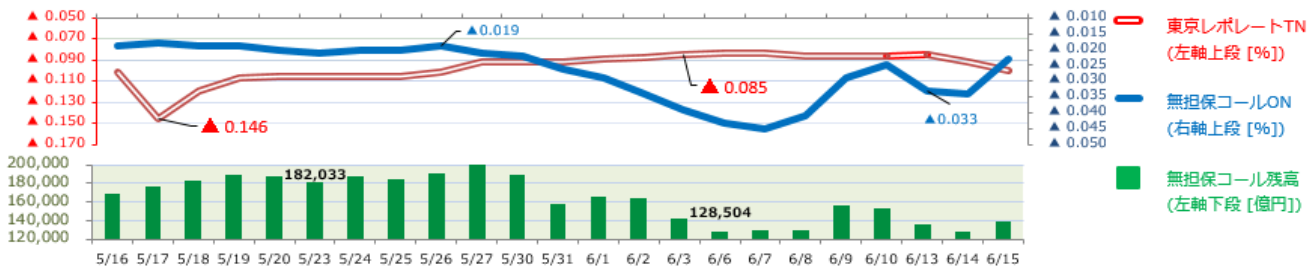
### 今月の国債買入オペ予定

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2日	0
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	2 9 15 23	6月2日	3
3年超5年以下	4,250~7,250	4,500	2 9 23 30	6月2日	3
5年超10年以下	4,750~8,750	5,750	9 15 23 30	5月29日	4
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	2 15 23 30	6月2日	3
25年超	500~3,500	1,000	9 15 30	5月29日	3
物価連動債	600	600	月1回	5月29日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	4月14日	0

### 1年前の市場推移

○2022年5月積み期 [5月16日~6月15日]

※積み初日及び積み最終日が平日・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