



短期市場の推移

	6月1日	6月2日	6月5日	6月6日
加重平均金利	▲0.070	▲0.072	▲0.068	▲0.058
東京レボレート(TN)	▲0.141	▲0.116	▲0.102	▲0.100
無コール残	165,556	166,029	155,047	170,297
ON	89,193	85,846	75,644	90,144
その他	76,363	80,183	79,403	80,153
有コール残	22,986	24,727	26,424	26,782

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	▲0.047	▲0.090
T/N	-	-	-	▲0.093
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.122
2W	-	-	▲0.050	▲0.133
3W	▲0.015	0.000	▲0.008	▲0.146
1M	-	-	-	▲0.171
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.163
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8日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	4月国際収支	1.6兆円増	(米) 週間新規失業保険申請件数	
	-		-	
	-		-	

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.050%の出合から始まり、その後は主に▲0.050%～▲0.045%の水準で取引された。ビッドサイドの調達意欲は依然として高く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.011%の▲0.047%となった。

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

翌営業日のマーケット

積み終盤に入り調整の調達意欲の高まりもあり、出合い水準は本日対比上昇を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月7日	6月8日	6月8日	6月9日	6月9日	6月9日
券	+100	▲100	▲100	▲1,000		
財政	▲10,900	+4,100	+4,100	▲5,000		
過不足	▲10,800	+4,000	+4,000	▲6,000		
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
国庫短期証券買入		+1,000				
共通担保(全店)	▲7,700	+8,000				
CP等買入			▲100			
社債等買入			▲200			
国債補充供給	+30,500	▲35,300	+35,300			
当座預金増減	▲14,300	+39,000	+39,000	▲6,000		
当座預金残高	5,328,600	5,367,600	5,367,600	5,361,600		
準備預金残高	4,666,600				主な需給要因	
積み終了先	4,666,000				流動性供給	
超過準備	4,666,000					
非準備先残高	662,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	74.2%					
乖離率	25.7%					

6月7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)(6/8~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(6/7~6/8)						
	32,271	32,271	▲0.350	▲0.351		
	2,938	2,938	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース 【億円】
6月6日時点 6,598,700

所要	【億円】
今積期の所要準備額	4,011,000
6月8日以降の残り所要	
積数	1,600
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
6月22日	5年
6月27日	20年
6月29日	2年
7月4日	10年

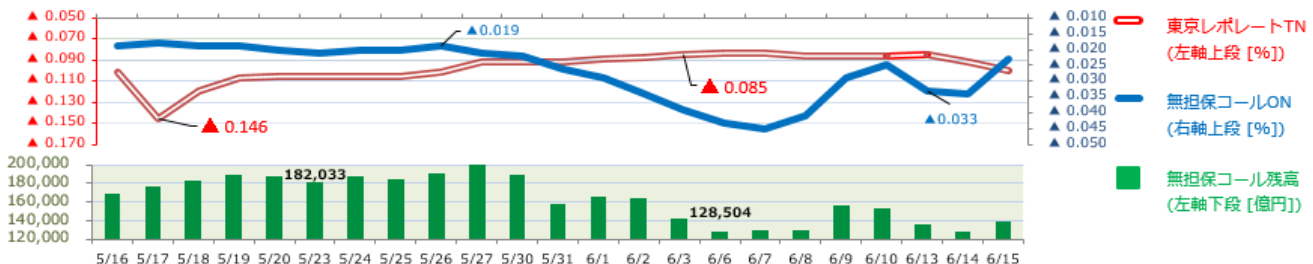
今月の国債買入オペ予定

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