



短期市場の推移

	6月2日	6月5日	6月6日	6月7日
加重平均金利	▲0.072	▲0.068	▲0.058	▲0.047
東京レポレート(TN)	▲0.116	▲0.102	▲0.100	▲0.093
無コール残	166,029	155,047	170,297	166,059
ON	85,846	75,644	90,144	91,856
その他	80,183	79,403	80,153	74,203
有コール残	24,727	26,424	26,782	26,372

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。

6月9日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-			-	
	-			-	
	-			-	

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	▲0.087	0.001	▲0.039	▲0.088
T/N	-	-	▲0.025	▲0.092
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.010	▲0.024	▲0.116
2W	▲0.060	▲0.057	▲0.059	▲0.127
3W	▲0.040	0.001	▲0.007	▲0.138
1M	-	-	0.100	▲0.166
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.161
6M	-	-	-	▲0.134
1Y	-	-	-	▲0.102

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.045%の出合から始まり、その後は主に▲0.045%~▲0.035%の水準で取引された。引き続きビッドサイドの調達意欲は強く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.008%の▲0.039%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.042 ~ ▲0.040	- ~ -	▲0.045 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

5月積み期最後の3日積みであり、調達意欲の強まりから出合いの水準は本日対比で上昇を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月8日		6月9日		6月12日	
券	▲100		+500		▲1,000	
財政	+1,200		▲8,300		+4,000	
過不足	+1,100		▲7,800		+3,000	
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
CP等買入	▲100		▲500			
社債等買入	▲200		▲2,400			
国債補充供給	+35,300	▲31,600	+31,600			
当座預金増減	+4,500		+20,900		+3,000	
当座預金残高	5,333,100		5,354,000		5,357,000	
準備預金残高	4,695,000		主な需給要因			
積み終了先	4,694,500		流動性供給		国庫短期証券発行・償還(3M・6M)	
超過準備	4,694,500					
非準備先残高	638,100					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	77.4%					
乖離率	22.5%					

6月8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)(6/9~)

5~10年	0	0
5~10年	0	0
5~10年	0	0

CP等買入(6/13~)

4,000	5,646	3,996	▲0.007	0.006	5.8
-------	-------	-------	--------	-------	-----

国債補充供給(6/8~6/9)

31,608	31,608	▲0.350	▲0.351
27	27	▲0.350	▲0.350

マネタリーベース	所要
6月7日時点	6,584,300

今積期の所要準備額	4,011,000
6月9日以降の残り所要	
積数	1,100
平均	200

国庫短期証券入札予定

6月9日	3ヶ月(第1162回)
6月15日	3ヶ月(第1163回)
6月19日	1年
6月23日	3ヶ月
6月22日	5年
6月27日	20年
6月29日	2年
7月4日	10年

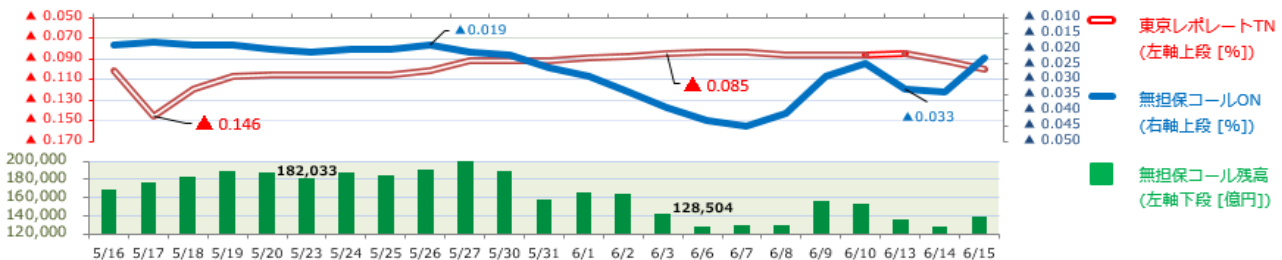
今月の国債買入オペ予定

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 15 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