



### 短期市場の推移

	6月5日	6月6日	6月7日	6月8日
加重平均金利	▲0.068	▲0.058	▲0.047	▲0.039
東京レポレート(TN)	▲0.102	▲0.100	▲0.093	▲0.092
無コール残	155,047	170,297	166,059	163,844
ON	75,644	90,144	91,856	91,921
その他	79,403	80,153	74,203	71,923
有コール残	26,424	26,782	26,372	25,076

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	▲0.087	0.001	▲0.028	▲0.088
T/N	-	-	-	▲0.089
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.020	▲0.113
2W	-	-	0.030	▲0.128
3W	-	-	-	▲0.151
1M	-	-	-	▲0.163
2M	-	-	0.000	-
3M	-	-	-	▲0.163
6M	-	-	-	▲0.135
1Y	-	-	-	▲0.102

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12日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本		海外	
	日本	予想	海外	予想
16:30	フェイルの発生状況 (5月)		-	
	-		-	
	-		-	

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.030%の出合から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.020%の水準で取引された。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.011%の▲0.028%となったが、一巡後はビッドが減少し▲0.070%台での出合いも見られた。本日公表された5月積み期間に適用する基準比率は、前積み期対比+2.5%の69.0%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.025	- ~ -	▲0.035 ~ ▲0.020

### 翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達ニーズが弱まり、出合いの水準は本日対比低下と予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月9日	6月12日	6月9日	6月12日	6月13日	6月13日
券	+500		+0		+0	
財政	▲8,500		▲100		+5,000	
過不足	▲8,000		▲100		+5,000	
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
国債買入				+15,600		
CP等買入	▲500				+4,000	
社債等買入	▲2,400					
国債補完供給	+31,600	▲32,200	+32,200			
当座預金増減	▲11,500		+47,700		+9,000	
当座預金残高	5,321,600		5,369,300		5,378,300	
準備預金残高	4,670,700					
積み終了先	4,670,600					
超過準備	4,670,400					
非準備先残高	650,900					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	87.1%					
乖離率	12.8%					

### 6月9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)(6/12~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(6/12~)						
1~3年	4,250	13,048	4,256	▲0.003	▲0.002	23.3
3~5年	4,500	9,635	4,508	▲0.003	▲0.002	10.2
5~10年	5,750	15,434	5,759	▲0.006	▲0.005	38.7
25年~	1,000	2,713	1,003	0.000	0.002	20.7
国債補完供給(6/9~6/12)						
	31,861	31,861	▲0.350	▲0.351		
	418	418	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)  
6月8日時点 6,588,800

所要	(億円)
今積期の所要準備額	4,011,000
6月12日以降の残り所要	
積数	200
平均	0

### 国庫短期証券入札予定

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30日	3ヶ月
国債入札予定	
6月22日	5年
6月27日	20年
6月29日	2年
7月4日	10年

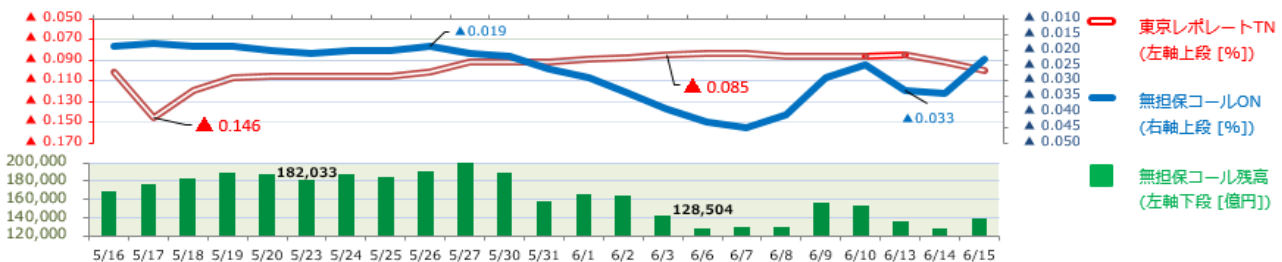
### 今月の国債買入オペ予定

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9日	2
3年超5年以下	4,250~7,250	4,500	2 9 23 30	6月9日	2
5年超10年以下	4,750~8,750	5,750	9 15 23 30	6月9日	3
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	6月9日	2
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した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