



短期市場の推移

	6月6日	6月7日	6月8日	6月9日
加重平均金利	▲0.058	▲0.047	▲0.039	▲0.028
東京レポレート(TN)	▲0.100	▲0.093	▲0.092	▲0.089
無コール残	170,297	166,059	163,844	171,264
ON	90,144	91,856	91,921	100,541
その他	80,153	74,203	71,923	70,723
有コール残	26,782	26,372	25,076	25,851

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	▲0.058	▲0.089
T/N	-	-	-	▲0.090
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.065	▲0.114
2W	▲0.070	▲0.003	▲0.063	▲0.131
3W	-	-	-	▲0.158
1M	-	-	-	▲0.164
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.020	▲0.164
6M	-	-	-	▲0.136
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13日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 (米) 消費者物価指数(5月)	-
-	-	(米) FOMC (14日まで)	-
-	-	-	-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.035%の合出から始まり、その後は主に▲0.087%~▲0.030%の水準で取引された。週末3日積み要因の剥落もあり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.030%の▲0.058%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.087 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達ニーズは弱く、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12日	6月13日	6月13日	6月14日	6月14日	6月14日
券	+100	+100	+100	+0		
財政	+4,100	▲2,100	▲2,100	▲5,000		
過不足	+4,200	▲2,000	▲2,000	▲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			▲100			
国債補完供給	+32,200	▲37,900	+37,900			
当座預金増減	+14,100	+39,300	+39,300	▲5,000		
当座預金残高	5,335,700	5,375,000	5,375,000	5,370,000		
準備預金残高	4,714,900	主な需給要因				
積み終了先	4,714,800		流動性供給			
超過準備	4,714,800		源泉税揚げ			
非準備先残高	620,800					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	90.3%					
乖離率	9.6%					

6月12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)(6/13~)	5~10年	0	0
5~10年	0	0	
5~10年	0	0	

国債補完供給(6/12~6/13)

38,047	38,047	▲0.350	▲0.351
0	0		

マネタリーベース	6月9日時点	6,576,800
----------	--------	-----------

所要	今積期の所要準備額	4,011,000
6月13日以降の残り所要	積数	100
	平均	0

国債短期証券入札予定

6月15日	3ヶ月(第1163回)
6月19日	1年(第1164回)
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

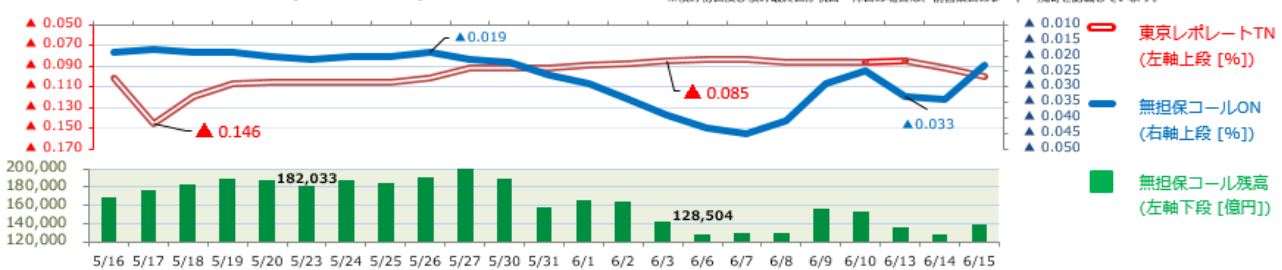
今月の国債買入オペ予定

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	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の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