



### 短期市場の推移

	6月7日	6月8日	6月9日	6月12日
加重平均金利	▲0.047	▲0.039	▲0.028	▲0.058
東京レポレート(TN)	▲0.093	▲0.092	▲0.089	▲0.090
無コール残	166,059	163,844	171,264	166,488
ON	91,856	91,921	100,541	94,835
その他	74,203	71,923	70,723	71,653
有コール残	26,372	25,076	25,851	26,670

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	▲0.079	▲0.095
T/N	-	-	-	▲0.106
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.075	0.005	▲0.067	▲0.120
2W	-	-	▲0.010	▲0.134
3W	-	-	-	▲0.160
1M	-	-	-	▲0.162
2M	-	-	-	-
3M	0.020	0.040	0.027	▲0.165
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14日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) FOMC	-
-	-	(米)パウエルFRB議長の会見	-
-	-	(欧) 4月鉱工業生産	-

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.080%の割合から始まり、その後は主に▲0.087%~▲0.078%の水準で取引された。調達ニーズの減退からビットレートは大幅に後退し、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.021%の▲0.079%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.083	▲0.087 ~ ▲0.085	▲0.087 ~ ▲0.070

### 翌営業日のマーケット

調達サイドの動態に主だった変化はなく、出合水準は本日対比横ばい圏を想定。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月13日		6月14日		6月15日	
債券	+0		▲600		+0	
財政	▲5,800		▲6,000		+73,000	
過不足	▲5,800		▲6,600		+73,000	
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	-	-
CP等買入	▲500	+4,000	▲300	-	-	-
社債等買入	▲100	-	-	-	-	-
国債補完供給	+37,900	▲40,200	+40,200	-	-	-
当座預金増減	▲4,700		+34,300		+73,000	
当座預金残高	5,331,000		5,365,300		5,438,300	
準備預金残高	4,676,300		主な需給要因			
積み終了先	4,676,200		流動性供給		年金定時払い	
超過準備	4,676,200		源泉税揚げ		個人向け国債発行・償還	
非準備先残高	654,700					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	93.5%					
乖離率	6.4%					

### 6月13日のオペ結果

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

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(6/14~)	1,000	7,082	1,002	0.005	0.005	46.8
国債買入(固定利回り方式)(6/14~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(6/15~6/22)	1	1	5,380	5,380		
国債補完供給(6/13~6/14)	40,285	40,285	▲0.350	▲0.351		
	54	54	▲0.350	▲0.350		
米ドル資金供給用担保国債供給(6/14~6/23)	5,000	2	2	▲0.100	▲0.100	

マネタリーベース [億円]  
6月12日時点 6,590,800

所要	今積期の所要準備額
6月14日以降の残り所要	4,011,000
積数	100
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(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

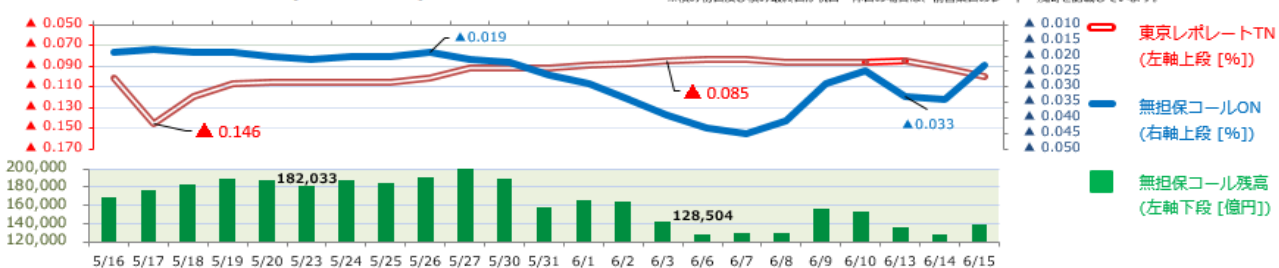
### 今月の国債買入オペ予定

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