



### 短期市場の推移

	6月9日	6月12日	6月13日	6月14日
加重平均金利	▲0.028	▲0.058	▲0.079	▲0.078
東京レボレート(TN)	▲0.089	▲0.090	▲0.106	▲0.110
無コール残	171,264	166,488	155,103	160,919
ON	100,541	94,835	80,130	67,744
その他	70,723	71,653	74,973	93,175
有コール残	25,851	26,670	27,382	26,719

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	▲0.012	▲0.094
T/N	-	-	-	▲0.102
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.045	▲0.122
2W	▲0.015	▲0.003	▲0.009	▲0.131
3W	-	-	0.060	▲0.164
1M	-	-	0.280	▲0.159
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.165
6M	-	-	-	▲0.135
1Y	-	-	-	▲0.101

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16日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀金融政策決定会合(2日目)			
日銀総裁記者会見			

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.073%の合出から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.065%の水準で取引された。積み最終日、最終調整を行いたい一部の取り手の調達意欲の旺盛さもあり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.008%の▲0.070%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.065	- ~ -	▲0.075 ~ ▲0.063

### 翌営業日のマーケット

積み替わりでもあるため、ビッドサイドの様子見姿勢から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15日	6月16日	6月16日	6月19日	6月19日	6月19日
券		▲600		+100		+2,000
財政		+79,800		+8,300		+4,000
過不足		+79,200		+8,400		+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
国債買入				+13,100		
CP等買入	▲600		▲300			
社債等買入	▲100					
国債補充供給	+36,500	▲37,000	+37,000			
貸出増加支援					▲28,000	+59,500
当座預金増減		+78,000		+58,200		+37,500
当座預金残高		5,405,100		5,463,300		5,500,800
準備預金残高		4,754,500				
積み終了先		4,754,500				
超過準備		4,754,500				
非準備先残高		650,600				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		100.0%				
乖離率		0.0%				

### 6月15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
国債買入(固定利回り方式)(6/16~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(6/16~)						
1~3年	4,250	11,299	4,254	0.005	0.006	52.9
5~10年	5,750	13,032	5,755	▲0.003	▲0.002	99.8
10~25年	2,000	4,013	2,003	▲0.004	▲0.001	38.9
25年~	1,000	2,077	1,007	0.010	0.011	76.1
国債補充供給(6/15~6/16)						
	36,770	36,770	▲0.350	▲0.351		
	300	300	▲0.350	▲0.350		
貸出増加を支援するための資金供給(2023/06/19~2027/06/19)						
	59,459	59,459				

マネタリーベース (億円)  
 6月14日時点 6,582,800

所要	(億円)
来積期の所要準備額	3,883,300
6月16日以降の残り所要	
積数	3,883,300
平均	129,400

### 国庫短期証券入札予定

入札日	期限	回数
6月19日	1年 (第1164回)	
6月23日	3ヶ月	
6月30日	3ヶ月	
7月6日	6ヶ月	

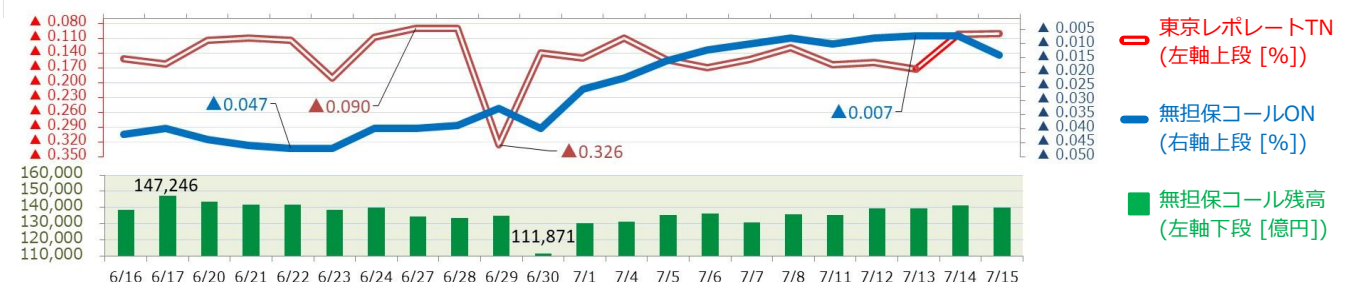
### 今月の国債買入オペ予定

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15日	1
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15日	2
10年超25年以下	6,000~5,000	2,000	2 15 23 30	6月15日	2
25年超	500~3,500	1,000	9 15 30	6月15日	1
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6月積み期 [6月16日~7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