



短期市場の推移

	6月12日	6月13日	6月14日	6月15日
加重平均金利	▲0.058	▲0.079	▲0.078	▲0.070
東京レポレート(TN)	▲0.090	▲0.106	▲0.110	▲0.102
無コール残	166,488	155,103	160,919	161,408
ON	94,835	80,130	69,646	69,646
その他	71,653	74,973	91,273	91,762
有コール残	26,670	27,382	26,719	27,663

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	▲0.032	▲0.091
T/N	-	-	-	▲0.091
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.033	▲0.113
2W	▲0.050	▲0.049	▲0.050	▲0.157
3W	-	-	-	▲0.159
1M	▲0.050	▲0.030	▲0.032	▲0.155
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.158
6M	-	-	-	▲0.134
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19日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.055%の出合から始まり、その後は主に▲0.070%~▲0.055%の水準で取引された。積み期も変わり、様子見姿勢ながらもビッドサイドの調達意欲は相応に回復し、週末要因も手強いON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.009%の▲0.061%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.070	- ~ -	▲0.070 ~ ▲0.055

翌営業日のマーケット

オファービッド共に主だった動態変化は見られず、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16日	6月19日	6月19日	6月20日	6月20日	6月20日
券	+100	▲700	▲700	+0	+0	+0
財政	+7,900	▲6,000	▲6,000	+69,000	+69,000	+69,000
過不足	+8,000	▲6,700	▲6,700	+69,000	+69,000	+69,000
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	▲300		▲200			
社債等買入			▲700			
国債補充供給	+37,000	▲39,000	+39,000			
貸出増加支援			▲26,800	+59,500		
当座預金増減	+18,800	+64,100	+64,100	+69,000	+69,000	+69,000
当座預金残高	5,423,900	5,488,000	5,488,000	5,557,000	5,557,000	5,557,000
準備預金残高	4,738,600					
積み終了先	4,723,300	国庫短期証券発行・償還(3M)	国庫短期証券発行・償還(1年)			
超過準備	3,460,000					
非準備先残高	685,300					
準備預金進捗率	98.8%					
平均	10.0%					
乖離率	88.8%					

6月16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)(6/19~)						
5~10年	0	0	0	0		
5~10年	0	0	0	0		
5~10年	0	0	0	0		
5~10年	0	0	0	0		
5~10年	0	0	0	0		
国債補充供給(6/16~6/19)	39,079	39,079	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マネタリーベース

6月15日時点 6,661,400

所要

今積期の所要準備額	3,883,300
6月19日以降の残り所要	
積数	47,700
平均	1,800

国庫短期証券入札予定

6月19日	1年(第1164回)
6月23日	3ヶ月(第1165回)
6月30日	3ヶ月
7月6日	6ヶ月

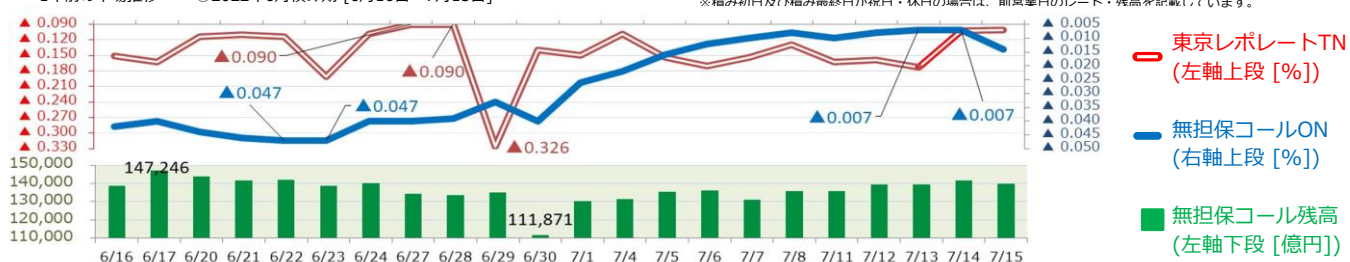
今月の国債買入オペ予定

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	1,000~5,000	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