



短期市場の推移

	6月15日	6月16日	6月19日	6月20日
加重平均金利	▲0.070	▲0.061	▲0.064	▲0.069
東京レボレート(TN)	▲0.102	▲0.091	▲0.091	▲0.091
無コール残	161,408	148,467	147,657	148,726
ON	88,215	77,865	75,600	75,619
その他	73,193	70,602	72,057	73,107
有コール残	27,663	27,771	26,729	27,930

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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.087	0.001	▲0.072	▲0.089
T/N	-	-	-	▲0.091
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.075	▲0.040	▲0.062	▲0.108
2W	-	-	-	▲0.147
3W	-	-	-	▲0.144
1M	-	-	-	▲0.145
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.023	▲0.153
6M	-	-	-	▲0.134
1Y	-	-	-	▲0.102

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22日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) 週間の新規失業保険申請件数	-
-	-	(英) 中銀金融政策委員会の結果	0.25%の利上げ
-	-	-	-

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▲0.085%~▲0.070%の水準で取引された。引き続きビッドサイドの調達意欲は弱く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.003%の▲0.072%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.080	- ~ -	▲0.080 ~ ▲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21日	6月22日	6月22日	6月23日	6月23日
券	▲700	▲900	▲900	+0	+0
財政	▲8,700	+6,900	+6,900	▲18,000	▲18,000
過不足	▲9,400	+6,000	+6,000	▲18,000	▲18,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)	▲8,000	+8,900	-	-	-
CP等買入	▲200	▲300	▲300	-	-
国債補充供給	+36,200	+37,400	+37,400	-	-
国庫短期証券買入	-	-	+1,000	-	-
社債等買入	-	-	+1,000	-	-
当座預金増減	▲9,900	+45,100	+45,100	▲18,000	▲18,000
当座預金残高	5,509,600	5,554,700	5,554,700	5,536,700	5,536,700
準備預金残高	4,841,900				
積み終了先	4,838,300				
超過準備	4,837,300				
非準備先残高	667,700				
準備預金進捗率	99.4%				
平均	20.0%				
乖離率	79.4%				

6月21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(6/22~)	1,000	8,516	1,001	0.016	0.016	76.6
国債買入(固定利回り方式)(6/22~)	5~10年	0	0	-	-	-
5~10年	0	0	-	-	-	-
国債補充供給(6/21~6/22)	37,273	37,273	▲0.350	▲0.351	-	-
	167	167	▲0.350	▲0.350	-	-

マネタリーベース (億円)
6月20日時点 6,777,100

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,883,300
6月22日以降の残り所要	
積数	23,900
平均	1,000

国庫短期証券入札予定

6月23日	3ヶ月(第1165回)
6月30日	3ヶ月
7月6日	6ヶ月
7月7日	3ヶ月

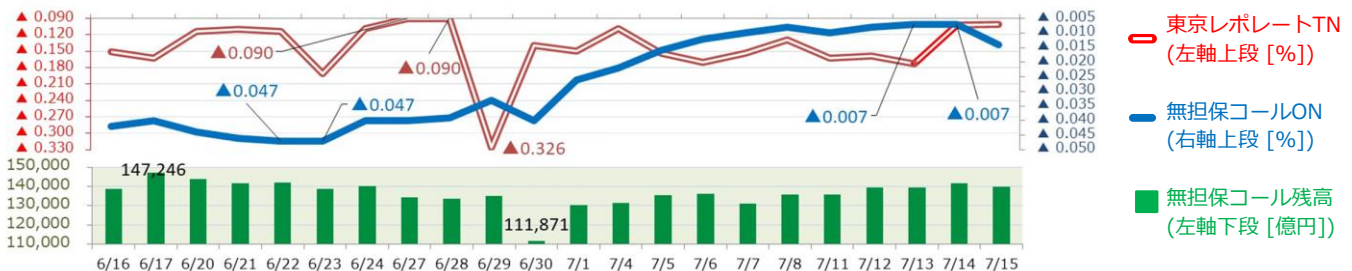
今月の国債買入オペ予定

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