



### 短期市場の推移

	6月19日	6月20日	6月21日	6月22日
加重平均金利	▲0.064	▲0.069	▲0.072	▲0.073
東京レボレート(TN)	▲0.091	▲0.091	▲0.091	▲0.091
無コール残	147,657	148,726	147,577	145,309
ON	75,600	75,619	74,015	70,722
その他	72,057	73,107	73,562	74,587
有コール残	26,729	27,930	27,440	28,771

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	▲0.074	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.075	0.008	▲0.053	▲0.121
2W	-	-	-	▲0.131
3W	-	-	-	▲0.135
1M	-	-	0.130	▲0.137
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.148
6M	-	-	-	▲0.132
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26日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	金融政策決定会合における 主な意見 (6月15・16日)			
	-		-	
	-		-	

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.075%の出合から始まり、その後は主に▲0.080%~▲0.073%の水準で取引された。オファービッドの動向に大きな変化はなく、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.074%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.078 ~ ▲0.078	▲0.080 ~ ▲0.073

### 翌営業日のマーケット

オファービッド共に動向に大きな変化はなく、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23日	6月26日	6月27日
券	▲700	▲100	▲1,000
財政	▲20,100	+9,000	+3,000
過不足	▲20,800	+8,900	+2,000
金融調節	エンド	スタート	スタート
国債買入		▲16,800	
CP等買入	▲500	▲300	
社債等買入	▲600	▲100	
国債補充供給	+35,500	+31,500	
当座預金増減	▲17,900	+56,800	+2,000
当座預金残高	5,502,100	5,558,900	5,560,900
準備預金残高	4,843,400		
積み終了先	4,841,400		
超過準備	4,841,400		
非準備先残高	658,700		
準備預金進捗率	99.6%		
平均	33.3%		
乖離率	66.3%		

### 6月23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)(6/26~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(6/26~)						
1~3年	4,250	6,218	4,251	▲0.008	▲0.006	89.6
3~5年	4,500	6,760	4,502	▲0.011	▲0.007	84.8
5~10年	5,750	9,200	5,753	▲0.002	0.001	50.0
10~25年	2,000	4,265	2,005	0.000	0.002	34.1
国債補充供給(6/23~6/26)						
	31,441	31,441	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

### マネタリーベース

6月22日時点 6,779,200

### 所要

今積期の所要準備額	所要
6月26日以降の残り所要	3,883,300
積数	15,800
平均	800

### 国庫短期証券入札予定

6月30日	3ヶ月(第1166回)
7月6日	6ヶ月
7月7日	3ヶ月
7月14日	3ヶ月
6月27日	20年
6月29日	2年
7月4日	10年
7月6日	30年

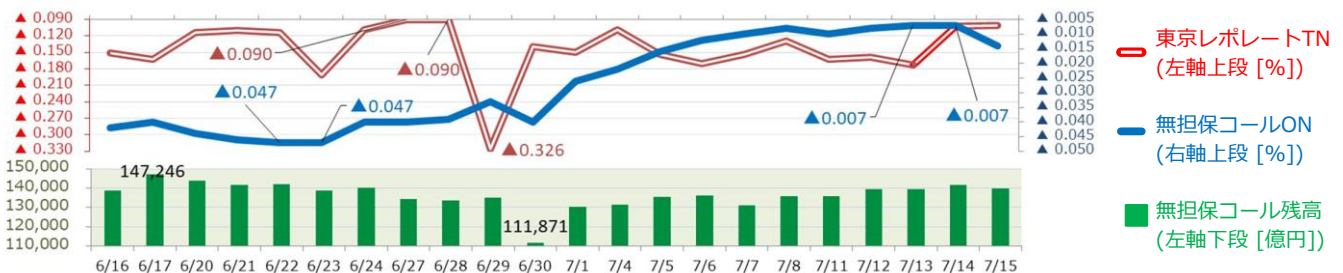
### 今月の国債買入オペ予定

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23日	0
3年超5年以下	4,250~7,250	4,500	2 9 23 30	6月23日	1
5年超10年以下	4,750~8,750	5,750	9 15 23 30	6月23日	1
10年超25年以下	6,000~10,000	2,000	2 15 23 30	6月23日	1
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