



短期市場の推移

	6月20日	6月21日	6月22日	6月23日
加重平均金利	▲0.069	▲0.072	▲0.073	▲0.074
東京レボレート(TN)	▲0.091	▲0.091	▲0.091	▲0.087
無コール残	148,726	147,577	145,309	146,849
ON	75,619	74,015	70,722	71,961
その他	73,107	73,562	74,587	74,888
有コール残	27,930	27,440	28,771	28,773

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	▲0.075	▲0.084
T/N	-	-	-	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.075	▲0.119
2W	▲0.070	0.010	▲0.061	▲0.122
3W	-	-	▲0.070	▲0.128
1M	-	-	0.130	▲0.132
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.142
6M	-	-	-	▲0.131
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27日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	ラガルドECB総裁の講演	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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%~▲0.075%の水準で取引された。引き続きビッドサイ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▲0.075%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.080 ~ ▲0.075

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26日	6月27日	6月27日	6月28日	6月28日	6月29日
券	▲100	▲1,000	▲1,000	▲1,000	▲1,000	+0
財政	+8,400	+0	+0	+0	+0	▲15,000
過不足	+8,300	+0	+0	+0	+0	▲15,000
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		+16,800				
CP等買入	▲300		▲100			
社債等買入	▲100					
国債補充供給	+31,500	▲38,700	+38,700			
当座預金増減	+17,500	+37,600	+37,600	▲15,000	▲15,000	▲15,000
当座預金残高	5,519,600	5,557,200	5,557,200	5,542,200	5,542,200	5,542,200
準備預金残高	4,864,700					
積み終了先	4,862,700					
超過準備	4,862,700					
非準備先残高	654,900					
準備預金進捗率	99.6%					
平均	36.7%					
乖離率	63.0%					

6月26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)(6/27~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(6/26~6/27)						
	38,616	38,616	▲0.350	▲0.351		
	53	53	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース 【億円】
 6月23日時点 6,762,000

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,883,300
6月27日以降の残り所要	
積数	13,800
平均	700

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

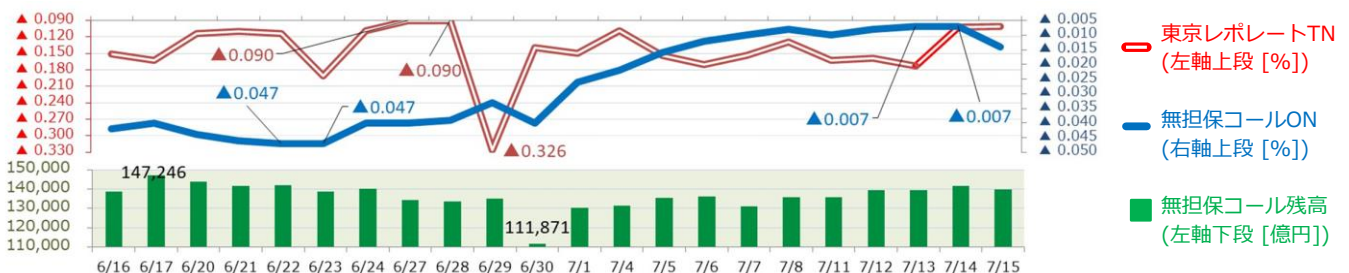
今月の国債買入オペ予定

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	1,000~5,000	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