



短期市場の推移

[億円] [%]

	6月21日	6月22日	6月23日	6月26日
加重平均金利	▲0.072	▲0.073	▲0.074	▲0.075
東京レポレート(TN)	▲0.091	▲0.091	▲0.087	▲0.086
無コール残	147,577	145,309	146,849	138,042
ON	74,015	70,722	71,961	64,314
その他	73,562	74,587	74,888	73,728
有コール残	27,440	28,771	28,773	30,437

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	▲0.074	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.115
2W	-	-	-	▲0.117
3W	-	-	0.150	▲0.126
1M	-	-	-	▲0.126
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.136
6M	-	-	-	▲0.132
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

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	6月27日		6月28日		6月29日
券	▲1,000		▲400		▲800
財政	▲1,200		▲19,500		+3,000
過不足	▲2,200		▲19,900		+2,200
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入				+1,000	
CP等買入	▲100	▲300			
国債補完供給	+38,700	▲37,500	+37,500		
当座預金増減	▲1,100		+18,300		+2,200
当座預金残高	5,518,500		5,536,800		5,539,000
準備預金残高	4,870,000		4,868,100		主な需給要因
積み終了先	4,868,100		4,868,100		国債発行(20年)
超過準備	4,868,100		4,868,100		
非準備先残高	648,500		648,500		
準備預金進捗率	99.7%		99.7%		
平均	40.0%		40.0%		
乖離率	59.7%		59.7%		

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
国債入札予定	
6月29日	2年
7月4日	10年
7月6日	30年
7月11日	5年

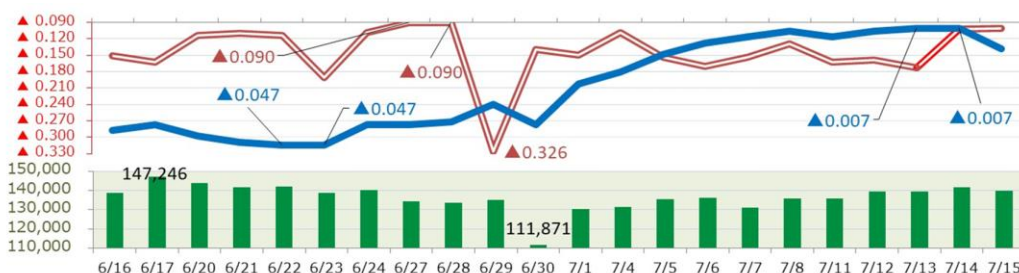
今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオペ金額	直近オペ金額	オペ予定日	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。

東京レポレートTN
(左軸上段 [%])無担保コールON
(右軸上段 [%])無担保コール残高
(左軸下段 [億円])

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