



短期市場の推移

	6月22日	6月23日	6月26日	6月27日
加重平均金利	▲0.073	▲0.074	▲0.075	▲0.074
東京レボレート(TN)	▲0.091	▲0.087	▲0.086	▲0.086
無コール残	145,309	146,849	138,042	143,641
ON	70,722	71,961	64,314	69,541
その他	74,587	74,888	73,728	74,100
有コール残	28,771	28,773	30,437	29,179

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	▲0.076	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.087
S/N	-	-	▲0.025	-
1W	-	-	-	▲0.113
2W	-	-	-	▲0.115
3W	-	-	-	▲0.122
1M	-	-	-	▲0.124
2M	-	-	-	-
3M	0.008	0.011	0.009	▲0.129
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29日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		(米) GDP (1~3月)	

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.078%の割合から始まり、その後は主に▲0.085%~▲0.077%の水準で取引された。市場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▲0.002%の▲0.076%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.085 ~ ▲0.075

翌営業日のマーケット

オファービッド共に動態変化は見られず、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28日	6月29日	6月30日
券	▲400	▲400	▲2,200
財政	▲19,300	+0	+3,300
過不足	▲19,700	▲400	+1,100
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+1,000		
CP等買入	▲300	▲700	+4,000
国債補完供給	+37,500	+39,500	
新型コロナ対応金融支援特別			▲51,900
当座預金増減	▲21,000	+38,400	▲46,800
当座預金残高	5,497,500	5,535,900	5,489,100
準備預金残高	4,848,500	主な需給要因	
積み終了先	4,846,700		
超過準備	4,846,700		
非準備先残高	649,000		
準備預金進捗率	99.7%		
平均	43.3%		
乖離率	56.4%		

6月28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)(6/29~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(6/28~6/29)						
	39,480	39,480	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
 6月27日時点 6,779,500

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,883,300
6月29日以降の残り所要	
積数	10,200
平均	600

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

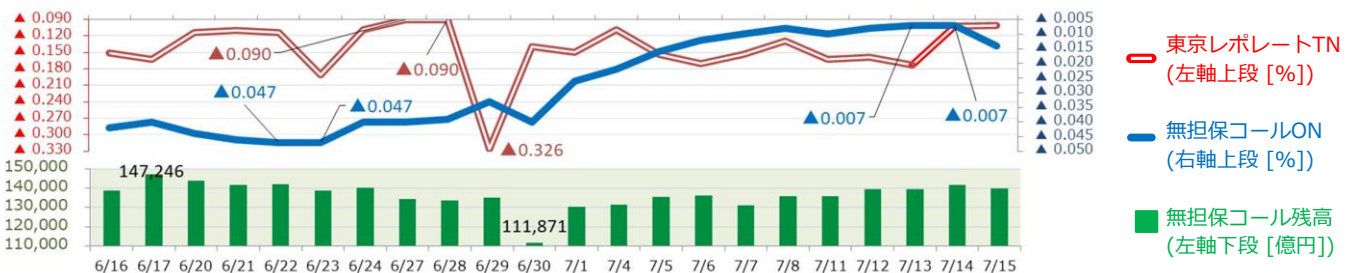
今月の国債買入オペ予定

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	6,000~5,000	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