



短期市場の推移

	6月26日	6月27日	6月28日	6月29日
加重平均金利	▲0.075	▲0.074	▲0.076	▲0.075
東京レボレート(TN)	▲0.086	▲0.086	▲0.087	▲0.086
無コール残	138,042	143,641	142,596	144,075
ON	64,314	69,541	69,846	73,525
その他	73,728	74,100	72,750	70,550
有コール残	30,437	29,179	30,494	30,603

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	▲0.077	▲0.084
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.068	▲0.104
2W	▲0.067	▲0.005	▲0.039	▲0.109
3W	-	-	-	▲0.117
1M	-	-	-	▲0.122
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.150	▲0.133
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

7月3日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	日銀短観		23:00	(米) 6月ISM製造業指数
	-			47.1
	-			-
	-			-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.080%の出合から始まり、その後は主に▲0.085%~▲0.075%の水準で取引された。月末のため調達を控える先も見られ、出合水準は低下しON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.077%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.087	- ~ -	▲0.085 ~ ▲0.075

翌営業日のマーケット

翌営業日は調達を控えていた取り手も、再開予定のため出合水準は本日対比上昇を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月30日	7月3日	7月3日	7月4日	7月4日	7月4日
券		+100		+200		+0
財政		+4,100		▲36,800		▲47,000
過不足		+4,200		▲36,600		▲47,000
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				+14,100		
CP等買入	▲3,300	+4,000				
国債補完供給	+41,000	+44,100				
新型コロナ対応金融支援特別	▲51,900					
当座預金増減		▲50,100		+21,600		▲47,000
当座預金残高		5,444,500		5,466,100		5,419,100
準備預金残高		4,767,200				
積み終了先		4,767,000	国債発行・償還(2年)	法人税・消費税揚げ		
超過準備		4,764,900	国庫短期証券発行・償還(3M)	保険揚げ		
非準備先残高		677,300				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		56.7%				
乖離率		43.2%				

6月30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)(7/3~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(7/3~)						
3~5年	4,500	10,229	4,502	▲0.003	▲0.002	70.2
5~10年	5,750	8,735	5,754	0.006	0.010	50.9
10~25年	2,000	4,318	2,001	0.017	0.019	27.1
25年~	1,000	2,877	1,006	0.027	0.030	71.2
物価連動	600	2,199	600	▲0.340	▲0.360	50.0
国債補完供給(6/30~7/3)						
	44,077	44,077	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
 6月29日時点 6,756,300

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,883,300
7月3日以降の残り所要	
積数	2,100
平均	200

国庫短期証券入札予定

7月6日	6ヶ月(第1167回)
7月7日	3ヶ月(第1168回)
7月14日	3ヶ月
7月19日	1年
7月4日	10年
7月6日	30年
7月11日	5年
7月13日	20年

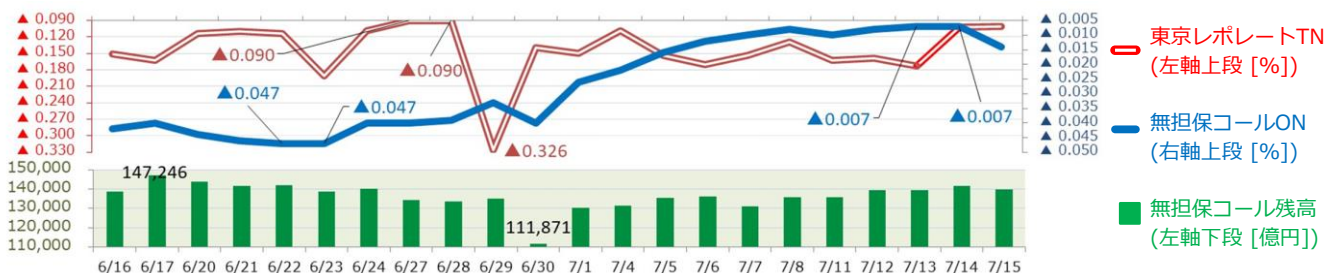
来月の国債買入オペ予定

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	1
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	5 10 14 20	6月23日	4
3年超5年以下	4,250~7,250	4,500	5 14 20 26	6月30日	4
5年超10年以下	4,750~8,750	5,750	10 14 20 26	6月30日	4
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	5 10 20 26	6月30日	4
25年超	500~3,500	1,000	10 14 26	6月30日	3
物価連動債	600	600	月1回	6月30日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	4月14日	1

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