



## 短期市場の推移

[億円] [%]

|                 | 6月8日   | 6月9日   | 6月10日  | 6月11日  |
|-----------------|--------|--------|--------|--------|
| 加重平均金利          | 0.727  | 0.727  | 0.727  | 0.727  |
| 東京レボ<br>レート(TN) | 0.754  | 0.754  | 0.754  | 0.753  |
| 無コール残           | 91,198 | 92,046 | 91,845 | 92,756 |
| ON              | 32,964 | 33,162 | 32,291 | 33,752 |
| その他             | 58,234 | 58,884 | 59,554 | 59,004 |
| 有コール残           | 23,712 | 23,760 | 24,326 | 24,070 |

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。無担保コール残高は無担保・有担保コール残高の重。

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<br>レート |
| O/N | 0.700      | 0.729 | 0.727 | 0.752       |
| T/N | -          | -     | -     | 0.755       |
| S/N | -          | -     | -     | -           |
| 1W  | -          | -     | -     | 0.903       |
| 2W  | 1.010      | 1.040 | 1.024 | 0.937       |
| 3W  | -          | -     | -     | 0.956       |
| 1M  | -          | -     | 1.150 | 0.975       |
| 2M  | -          | -     | -     | -           |
| 3M  | -          | -     | 1.180 | 0.983       |
| 6M  | -          | -     | -     | 1.004       |
| 1Y  | -          | -     | -     | 1.142       |

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

資金需給

[億円]

|         | 日銀速報      | 日銀予想                                       | 当社需給予想    |
|---------|-----------|--------------------------------------------|-----------|
|         | 6月12日     | 6月15日                                      | 6月16日     |
| 券       | ▲100      | +400                                       | +0        |
| 財政      | +20,100   | +78,000                                    | +4,000    |
| 過不足     | +20,000   | +78,400                                    | +4,000    |
| 金融調節    | エンド       | エンド                                        | エンド       |
| 社債等買入   | ▲100      | ▲200                                       |           |
| 国債補完供給  | +1,700    | +2,900                                     |           |
| 国債買入    | +7,500    |                                            |           |
| 当座預金増減  | +26,200   | +81,100                                    | +4,000    |
| 当座預金残高  | 4,375,000 | 4,456,100                                  | 4,460,100 |
| 準備預金残高  | 4,065,600 | 主な需給要因                                     |           |
| 積み終了先   | 4,065,600 | 国庫短期証券発行償還<br>(3M)<br>国債発行償還(個人)<br>年金定時払い |           |
| 超過準備    | 4,065,600 |                                            |           |
| 非準備先残高  | 309,400   |                                            |           |
| 準備預金進捗率 | 100.0%    |                                            |           |
| 平均      | 96.8%     |                                            |           |
| 乖離率     | 3.2%      |                                            |           |

## 国庫短期証券入札予定

|       |             |
|-------|-------------|
| 6月18日 | 1年(第1388回)  |
| 6月19日 | 3ヶ月(第1389回) |
| 6月26日 | 3ヶ月         |
| 7月3日  | 3ヶ月         |

## 国債入札予定

|       |     |
|-------|-----|
| 6月23日 | 5年  |
| 6月25日 | 20年 |
| 6月30日 | 2年  |
| 7月2日  | 10年 |

## 今月の国債買入オペ予定

| オペ種類      | 一回当たりオペファー金額 | 直近オペファー額 | オペファー予定日 |    |    |  |  | 直近日   | 残り回数 |
|-----------|--------------|----------|----------|----|----|--|--|-------|------|
| 1年以下      | 1,000        | 1,000    | 3        |    |    |  |  | 6月3日  | 0    |
| 1年超3年以下   | 2,550        | 2,550    | 11       | 18 | 26 |  |  | 6月11日 | 2    |
| 3年超5年以下   | 2,300        | 2,300    | 3        | 11 | 18 |  |  | 6月11日 | 1    |
| 5年超10年以下  | 2,400        | 2,400    | 11       | 18 | 26 |  |  | 6月11日 | 2    |
| 10年超25年以下 | 800          | 800      | 3        | 11 | 18 |  |  | 6月11日 | 1    |
| 25年超      | 750          | 750      | 3        | 26 |    |  |  | 6月3日  | 1    |
| 物価連動債     | 400          | 400      | 26       |    |    |  |  | 5月28日 | 1    |
| 変動利付債     | -            | 300      |          |    |    |  |  | 4月14日 | -    |

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