



短期市場の推移

	6月6日	6月7日	6月10日	6月11日
加重平均金利	0.077	0.078	0.078	0.078
東京レボレート(TN)	0.056	0.062	0.043	0.044
無コール残	86,268	84,977	79,352	79,219
ON	39,798	39,357	33,242	33,159
その他	46,470	45,620	46,110	46,060
有コール残	39,168	38,165	38,422	37,848

6月13日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀政策決定会合 (1日目)			
-		-	
-		-	

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	0.040	0.212	0.078	0.077
T/N	-	-	-	0.047
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.240	0.052
2W	-	-	-	0.052
3W	-	-	-	0.051
1M	-	-	-	0.052
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.087
6M	-	-	-	0.135
1Y	-	-	-	0.201

本日の市況

無担保コールON物は0.078%の出合から始まり、その後は主に0.075%~0.078%を中心に取引された。ビットサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.078%となった。

都銀・信託	証券	地銀
0.074 ~ 0.074	- ~ -	0.075 ~ 0.078

翌営業日のマーケット

引き続きビットサイドの資金調達ニーズは底堅く、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	6月12日	6月13日	6月13日	6月14日	6月14日
券	+600	▲100	▲100	▲2,000	▲2,000
財政	▲1,200	▲1,100	▲1,100	+75,000	+75,000
過不足	▲600	▲1,200	▲1,200	+73,000	+73,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入			+12,900		
共通担保(全店)	▲7,200	+8,000			
CP等買入	▲100		▲200		+3,000
国債補充供給	+28,800	▲33,300	+33,300		
当座預金増減	▲4,400	+44,800	+44,800	+76,000	+76,000
当座預金残高	5,390,900	5,435,700	5,435,700	5,511,700	5,511,700
準備預金残高	4,743,100				
積み終了先	4,743,000				
超過準備	4,743,000				
非準備先残高	647,800				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	90.3%				
乖離率	9.6%				

6月12日のオペ結果

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(6/13~)						
1~3年	3,750	12,303	3,752	▲0.019	▲0.015	38.2
3~5年	4,250	6,766	4,252	▲0.028	▲0.023	48.9
5~10年	4,250	11,909	4,262	▲0.024	▲0.022	5.9
25年~	750	2,654	752	▲0.015	▲0.008	25.2
国債補充供給(6/12~6/13)						
	34,216	34,216	▲0.250	▲0.250		
	0	0				

マネタリーベース [億円]  
6月11日時点 6,632,900

所要	所要
今積期の所要準備額	4,081,200
6月13日以降の残り所要	
積数	200
平均	100

国庫短期証券入札予定

6月13日	3ヶ月(第1237回)
6月19日	1年(第1238回)
6月21日	3ヶ月
6月28日	3ヶ月
国債入札予定	
6月20日	5年
6月25日	20年
6月27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7日	0
1年超3年以下	3,000~4,500	3,750	7 12 18 24	6月12日	2
3年超5年以下	3,500~5,000	4,250	12 18 24 28	6月12日	3
5年超10年以下	4,000~5,500	4,250	7 12 18 24	6月12日	2
10年超25年以下	1,000~2,000	1,500	7 18 28	6月7日	2
25年超	500~1,000	750	12 28	6月12日	1
物価連動債	600	600	月1回	5月31日	1
変動利付債	-	300	-	2023/4/14	-

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