



短期市場の推移

	6月10日	6月11日	6月12日	6月13日
加重平均金利	0.078	0.078	0.078	0.077
東京レポレート(TN)	0.043	0.044	0.047	0.030
無コール残	79,352	79,219	76,649	77,443
ON	33,242	33,159	30,689	31,413
その他	46,110	46,060	45,960	46,030
有コール残	38,422	37,848	38,493	39,354

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	0.040	0.150	0.077	0.037
T/N	-	-	-	0.032
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.043
2W	-	-	0.130	0.043
3W	-	-	-	0.044
1M	-	-	0.230	0.041
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.200	0.086
6M	-	-	-	0.135
1Y	-	-	-	0.200

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

6月17日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-			-	
	-			-	
	-			-	

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。ビッド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0.077%となった。日本銀行は本日開催の金融政策決定会合にて、長期国債買入れを減額していく方針を決定した。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	0.075 ~ 0.078

翌営業日のマーケット

新積み期初日のため、ビッドサイドの資金調達ニーズは旺盛であり、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	6月14日	6月17日	6月17日	6月18日	6月18日	6月18日
券	+500		+800		+0	
財政	+78,600		+700		+2,000	
過不足	+79,100		+100		+2,000	
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
CP等買入	▲300	+3,000	▲100			
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+35,100	▲34,500	+34,500			
当座預金増減	+82,300		+34,500		+2,000	
当座預金残高	5,478,600		5,513,100		5,511,100	
準備預金残高	4,828,200	主な需給要因				
積み終了先	4,828,200	国庫短期証券発行償還(3M)				
超過準備	4,828,100	国債発行償還(個人)				
非準備先残高	650,400					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	100.0%					
乖離率	0.0%					

6月14日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(6/14~6/17)	35,440	35,440	▲0.250	▲0.250		
	1	1	▲0.250	▲0.250		

マネタリーベース [億円]
6月13日時点 6,633,400

所要	[億円]
来積期の所要準備額	3,942,000
6月17日以降の残り所要	
積数	492,100
平均	17,000

国庫短期証券入札予定

6月19日	1年 (第1238回)
6月21日	3ヶ月(第1239回)
6月28日	3ヶ月
7月5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	-

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

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