



デイリーシグナル

2022年7月6日(水)

短期市場の推移

	6月30日	7月1日	7月4日	7月5日
加重平均金利	▲0.040	▲0.026	▲0.022	▲0.016
東京レボレート(TN)	▲0.139	▲0.150	▲0.109	▲0.153
無コール残	111,871	130,510	131,525	135,413
ON	72,196	68,925	64,370	67,018
その他	39,675	61,585	67,155	68,395
有コール残	25,113	25,584	29,879	27,701

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	▲0.050	0.001	▲0.012	▲0.106
T/N	-	-	▲0.014	▲0.170
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.010	▲0.169
2W	-	-	▲0.025	▲0.165
3W	-	-	-	▲0.163
1M	-	-	-	▲0.167
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.149
6M	-	-	-	▲0.135
1Y	-	-	-	▲0.132

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7日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:15 (米)6月ADP全米雇用報告	18.3万人
-	-	21:30 (米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
-	-	21:30 (米)5月貿易収支	-850億米ドル

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.010%の合出から始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.008%の水準で取引された。昨日に引き続きビットサイドの調達ニーズは強く、無担保コールON物加重平均金利(速報)は前日対比+0.004%の▲0.012%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.015 ~ ▲0.010	▲0.010 ~ ▲0.010	▲0.010 ~ ▲0.008

翌営業日のマーケット

引き続きビットサイドの調達意欲は強く、出合水準は本日対比若干の上昇と予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月6日	7月7日	7月7日	7月8日	7月8日	7月8日
券	+300	▲700	▲700	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲27,400	+1,700	+1,700	▲7,000	▲7,000	▲7,000
過不足	▲27,100	+1,000	+1,000	▲8,000	▲8,000	▲8,000
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
国庫短期証券買入		+1,000				
国債買入				+12,500		
共通担保(全店)	▲4,500	+3,100				
CP等買入	▲100					
国債補充供給	+16,300	▲16,700	+16,700			
当座預金増減	▲28,000	+30,200	+30,200	▲8,000	▲8,000	▲8,000
当座預金残高	5,460,200	5,490,400	5,490,400	5,482,400	5,482,400	5,482,400
準備預金残高	4,780,200					
積み終了先	4,780,100					
超過準備	4,780,100					
非準備先残高	680,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	70.0%					
乖離率	29.9%					

7月6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)(7/7~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(7/7~)						
~1年	1,500	1,530	1,500	▲0.030	▲0.009	92.5
1~3年	4,750	15,663	4,755	▲0.002	0.000	42.1
3~5年	4,750	15,265	4,756	▲0.005	▲0.004	22.1
10~25年	1,250	3,825	1,255	▲0.007	▲0.005	10.0
国債補充供給(7/6~7/7)						
	16,106	16,106	▲0.450	▲0.450		
	491	491	▲0.450	▲0.450		

マナタリーベース 【億円】
7月5日時点 6,739,100

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,743,800
7月7日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

国庫短期証券入札予定

7月7日	6ヶ月(第1092回)
7月8日	3ヶ月(第1093回)
7月15日	3ヶ月
7月19日	1年
国債入札予定	
7月7日	30年
7月12日	5年
7月14日	20年
7月26日	40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	7月6日	-			
1年超3年以下	4750	4,750	6	13	19	25	7月6日	3
3年超5年以下	4750	4,750	6	19	25	29	7月6日	3
5年超10年以下	5000	5,000	13	19	25	29	6月29日	4
10年超25年以下	1250	1,250	6	25			7月6日	1
25年超	500	500	13	29			6月22日	2
物価連動債	600	600	月1回	6月29日	1			
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	4月8日	1			

1年前の市場推移

○2021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