



## デイリーシグナル

2022年7月11日(月)

### 短期市場の推移

	7月5日	7月6日	7月7日	7月8日
加重平均金利	▲0.016	▲0.012	▲0.010	▲0.008
東京レボレート(TN)	▲0.153	▲0.170	▲0.153	▲0.129
無コール残	135,413	136,262	131,087	135,988
ON	67,018	67,164	60,889	66,390
その他	68,395	69,098	70,198	69,598
有コール残	27,701	30,555	29,597	29,973

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	▲0.045	0.001	▲0.010	▲0.146
T/N	-	-	▲0.010	▲0.163
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	▲0.010	▲0.013	▲0.161
2W	-	-	▲0.020	▲0.162
3W	-	-	-	▲0.159
1M	-	-	0.160	▲0.161
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.150
6M	-	-	-	▲0.142
1Y	-	-	-	▲0.134

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12日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本		海外	
	日本	予想	海外	予想
8:50	6月国内企業物価指数 [前年比]	-	-	-
	-	-	-	-
	-	-	-	-

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▲0.008%の出合から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.005%の水準で取引された。引き続き資金ニーズは強いものの、3日積み要因の剥落により無担保コールON物加重平均金利(速報)は前日対比▲0.002%の▲0.010%となった。また、本日日本銀行より7月積み期の基準比率が公表され、前積み期対比+4.5%の25.5%であった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.008	~ ▲0.007	▲0.008 ~ ▲0.008	▲0.010 ~ ▲0.005

### 翌営業日のマーケット

資金ニーズは底堅く、出合水準は本日対比で横ばいを予想する。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	7月11日	7月12日	7月12日	7月13日	7月13日
券		+800		+200	▲1,000
財政		+2,700		▲12,400	▲43,000
過不足		+3,500		▲12,200	▲44,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲100				+4,000
社債等買入			▲200		
国債補完供給	+13,400	▲14,500	+14,500		
当座預金増減		+2,300		+2,100	▲40,000
当座預金残高		5,479,300		5,481,400	5,441,400
準備預金残高		4,790,300	主な需給要因		
積み終了先		4,790,300			国債発行(5年)
超過準備		4,790,300			源泉所得税揚げ
非準備先残高		689,000			
準備預金進捗率		100.0%			
平均乖離率		86.7%			
		13.3%			

### 7月11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)(7/12~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(7/11~7/12)						
	14,349	14,349	▲0.350	▲0.352		
	89	89	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース (億円)  
7月8日時点 6,728,000

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,746,400
7月12日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

### 国庫短期証券入札予定

7月15日	3ヶ月(第1094回)
7月19日	1年
7月20日	6ヶ月
7月22日	3ヶ月
7月12日	5年
7月14日	20年
7月26日	40年
7月28日	2年

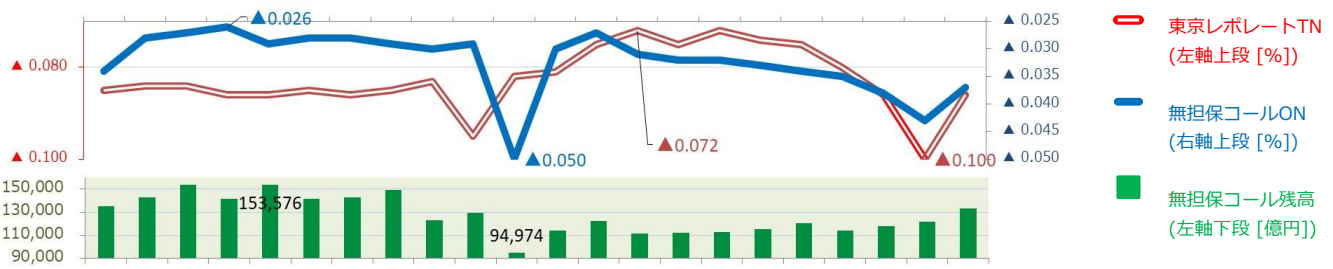
### 今月の国債買入オペ予定

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