



デイリーシグナル

2022年7月14日(木)

短期市場の推移

	7月8日	7月11日	7月12日	7月13日
加重平均金利	▲0.008	▲0.010	▲0.008	▲0.007
東京レポレート(TN)	▲0.129	▲0.163	▲0.159	▲0.173
無コール残	135,988	135,653	139,428	139,598
ON	66,390	65,255	69,080	69,615
その他	69,598	70,398	70,348	69,983
有コール残	29,973	27,359	28,011	29,972

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	▲0.045	0.001	▲0.007	▲0.099
T/N	-	-	▲0.025	▲0.102
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	0.000	▲0.012	▲0.134
2W	▲0.030	0.180	▲0.002	▲0.141
3W	-	-	-	▲0.141
1M	▲0.035	0.020	▲0.010	▲0.144
2M	-	-	0.020	-
3M	0.000	0.010	0.003	▲0.151
6M	-	-	-	▲0.140
1Y	-	-	-	▲0.133

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

7月15日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30	(米)6月小売売上高 0.9%
-	-	22:15	(米)6月鉱工業生産指数 [前月比] 0.0%
-	-	-	-

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▲0.005%の出合から始まり、その後は主に▲0.008%~▲0.003%の水準で取引された。オファーサイド・ビッドサイドともに大きな動向変化はなく、無担保コールON物加重平均金利(速報)は前日対比横ばいの▲0.007%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.005 ~ ▲0.005	▲0.004 ~ ▲0.004	▲0.008 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

積み最終日となるがエンドが来積み期にかかるため、出合水準は本日対比やや低下を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	7月14日	7月15日	7月14日	7月15日	7月19日
券	▲1,000			+0	+1,000
財政	+3,400			+5,100	+3,000
過不足	+2,400			+5,100	+4,000
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		+10,800			
CP等買入	▲400		▲800		
社債等買入			▲100		
国債補完供給	+11,100	▲9,800	+9,800		
当座預金増減	+14,100		+14,000		+4,000
当座預金残高	5,443,300		5,457,300		5,461,300
準備預金残高	4,762,400		4,762,400		4,762,400
積み終了先	4,762,400		4,762,400		4,762,400
超過準備	4,762,400		4,762,400		4,762,400
非準備先残高	680,900		680,900		680,900
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%
平均	96.7%		96.7%		96.7%
乖離率	3.3%		3.3%		3.3%

7月14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(固定利回り方式)(7/15~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(7/14~7/15)						
	9,728	9,728	▲0.450	▲0.450		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
7月13日時点 6,679,300

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,746,400
7月15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(第1095回)
7月20日	6ヶ月(第1096回)
7月22日	3ヶ月

国債入札予定

7月26日	40年
7月28日	2年
8月2日	10年
8月4日	物価連動

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13日	2
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	7月13日	3
10年超25年以下	1250	1,250	6 25	7月6日	1
25年超	500	500	13 29	7月13日	1
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	7月13日	-

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