



デイリーシグナル

2022年7月15日(金)

短期市場の推移

	7月11日	7月12日	7月13日	7月14日
加重平均金利	▲0.010	▲0.008	▲0.007	▲0.007
東京レポレート(TN)	▲0.163	▲0.159	▲0.173	▲0.102
無コール残	135,653	139,428	139,598	141,567
ON	65,255	69,080	69,615	72,094
その他	70,398	70,348	69,983	69,473
有コール残	27,359	28,011	29,972	29,544

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	▲0.055	0.001	▲0.014	▲0.093	
T/N	-	-	▲0.013	▲0.101	
S/N	-	-	-	-	
1W	-	-	▲0.015	▲0.124	
2W	▲0.040	0.100	▲0.028	▲0.138	
3W	-	-	▲0.025	▲0.142	
1M	-	-	0.001	▲0.147	
2M	-	-	-	-	
3M	-	-	-	▲0.148	
6M	-	-	-	▲0.141	
1Y	-	-	-	▲0.136	

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19日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
6月の業感別の日銀当座預金残高(日銀)		(欧) 6月の消費者物価(確報)	
-		-	
-		-	

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▲0.015%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。積み期最終日であったが、全般的には新積み期にかかる取引のため、ビッドサイドの警戒姿勢からレートは低下した。ON物加重平均金利(速報)は前日対比▲0.007%の▲0.014%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.015	▲0.015 ~ ▲0.010	▲0.020 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの慎重な調達姿勢は変わらず、出合いの水準は本日対比横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月15日	7月19日	7月19日	7月20日	7月20日	7月20日
債券		+0		+900		+500
財政		+2,000		+6,800		+2,000
過不足		+2,000		+7,700		+2,500
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	▲800		▲200			
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+9,800	▲9,400	+9,400			
共通担保(全店)						▲3,100
当座預金増減		+1,500		+16,900		▲600
当座預金残高		5,444,800		5,461,700		5,461,100
準備預金残高		4,793,200	主な需給要因			
積み終了先		4,793,200	国庫短期証券発行	国庫短期証券発行		
超過準備		4,793,200	・償還(3M)	・償還(1Y)		
非準備先残高		651,600				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		100.0%				
乖離率		0.0%				

7月15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)(7/19~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
社債等買入(7/21~)						
	1,000	1,223	1,000	0.159	0.220	46.2
国債補完供給(7/15~7/19)						
	9,269	9,269	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
7月14日時点 6,694,300

所要	(億円)
来積期の所要準備額	3,870,200
7月19日以降の残り所要	
積数	23,300
平均	800

国庫短期証券入札予定

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(第1097回)
7月29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

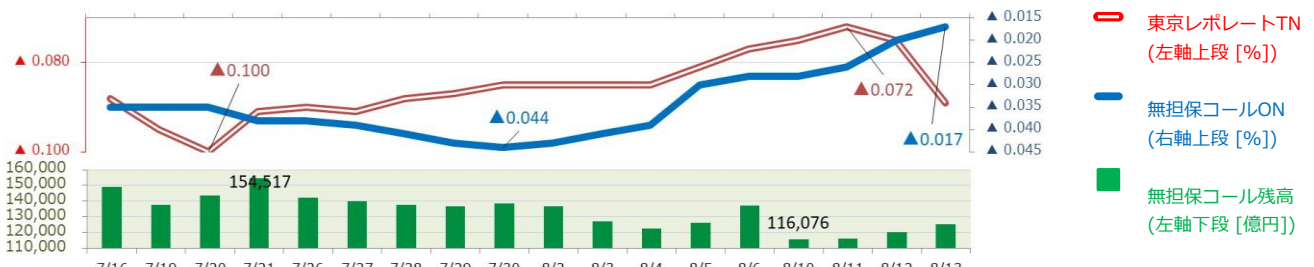
今月の国債買入オペ予定

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7月積み期 [7月16日~8月13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