



デイリーシグナル

2022年7月21日(木)

短期市場の推移

	7月14日	7月15日	7月19日	7月20日
加重平均金利	▲0.007	▲0.014	▲0.019	▲0.014
東京レポレート(TN)	▲0.102	▲0.101	▲0.098	▲0.138
無コール残	141,567	139,844	136,464	141,911
ON	72,094	73,156	73,586	77,028
その他	69,473	66,688	62,878	64,883
有コール残	29,544	29,392	29,625	30,053

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	▲0.060	0.001	▲0.012	▲0.126
T/N	-	-	▲0.010	▲0.186
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.155
2W	▲0.010	0.150	0.006	▲0.156
3W	-	-	▲0.035	▲0.157
1M	▲0.040	▲0.008	▲0.023	▲0.158
2M	-	-	0.001	-
3M	-	-	-	▲0.150
6M	-	-	-	▲0.146
1Y	-	-	-	▲0.142

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22日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	6月消費者物価コア指数[前年比]	-	17:00	(欧)7月製造業購買担当者指数(PMI)	51.0
	-		17:00	(欧)7月サービス業購買担当者指数(PMI)	52.0
	-		17:00	(欧)7月購買担当者総合指数(PMI)	50.9

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%の出合から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.008%の水準で取引された。昨日同様、ビットサイドの資金調達ニーズが強く、ON物加重平均金利(速報)は前日対比+0.002%の▲0.012%となった。本日開催された日銀金融政策決定会合では金融政策の現状維持が決定された。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.020	▲0.020 ~ ▲0.010	▲0.020 ~ ▲0.008

翌営業日のマーケット

引き続き資金調達ニーズは底堅く、出合水準は本日対比で上昇を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月21日	7月22日	7月21日	7月22日	7月21日	7月22日
券	▲400	▲400	▲400	▲400	+2,000	+2,000
財政	▲7,000	+9,100	▲7,000	+9,100	+17,000	+17,000
過不足	▲7,400	+8,700	▲7,400	+8,700	+19,000	+19,000
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	▲200	▲100	▲200	▲100		
社債等買入	▲100	+1,000	▲100	+1,000		
国債補完供給	+9,700	▲11,700	+9,700	▲11,700		
気候変動対応		+16,000		+16,000		
当座預金増減	+7,300	+20,200	+7,300	+20,200	+19,000	+19,000
当座預金残高	5,470,700	5,490,900	5,470,700	5,490,900	5,509,900	5,509,900
準備預金残高	4,777,000	4,774,100	4,777,000	4,774,100	4,774,100	4,774,100
積み終了先	4,773,800	4,773,800	4,773,800	4,773,800	4,773,800	4,773,800
超過準備	693,700	693,700	693,700	693,700	693,700	693,700
非準備先残高	693,700	693,700	693,700	693,700	693,700	693,700
準備預金進捗率	99.8%	99.8%	99.8%	99.8%	99.8%	99.8%
平均	19.4%	19.4%	19.4%	19.4%	19.4%	19.4%
乖離率	80.4%	80.4%	80.4%	80.4%	80.4%	80.4%

7月21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)(7/22~)						
5~10年	0	0	0	0		
5~10年	0	0	0	0		
5~10年	0	0	0	0		
5~10年	0	0	0	0		
国債補完供給(7/21~7/22)						
	11,566	11,566	▲0.350	▲0.350		
	42	42	▲0.350	▲0.350		

国庫短期証券入札予定

7月22日	3ヶ月(第1097回)
7月29日	3ヶ月
8月5日	3ヶ月
8月9日	6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	7月6日	7月6日	-			
1年超3年以下	4750	4,750	6	13	19	25	7月19日	1
3年超5年以下	4750	4,750	6	19	25	29	7月19日	2
5年超10年以下	5000	5,000	13	19	25	29	7月19日	2
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