



デイリーシグナル

2022年7月22日(金)

短期市場の推移

	7月15日	7月19日	7月20日	7月21日
加重平均金利	▲0.014	▲0.019	▲0.014	▲0.012
東京レボレート(TN)	▲0.101	▲0.098	▲0.138	▲0.186
無コール残	139,844	136,464	141,911	142,199
ON	73,156	73,586	77,028	74,251
その他	66,688	62,878	64,883	67,948
有コール残	29,392	29,625	30,053	31,577

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	▲0.060	0.001	▲0.009	▲0.102
T/N	▲0.009	▲0.008	▲0.009	▲0.155
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	▲0.008	▲0.013	▲0.150
2W	▲0.010	▲0.008	▲0.010	▲0.152
3W	-	-	-	▲0.154
1M	▲0.040	▲0.010	▲0.023	▲0.156
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.153
6M	-	-	-	▲0.147
1Y	-	-	-	▲0.142

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25日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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%の割合から始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.005%の水準で取引された。引き続き、ビッド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+0.003%の▲0.009%となった。

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

翌営業日のマーケット

3日積み要因剥落も、依然ビッドサイドの調達意欲は底堅く本日対比横ばいを想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月22日	7月23日	7月25日	7月26日	7月26日	7月27日
券		▲400	+400	+500		
財政		+7,800	+24,200	+2,000		
過不足		+7,400	+24,600	+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	▲100		▲100			
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+11,700	▲8,900	+8,900			
当座預金増減		+10,000	+33,400	+2,500		
当座預金残高		5,480,700	5,514,100	5,516,600		
準備預金残高		4,799,000				
積み終了先		4,798,300				
超過準備		4,797,600				
非準備先残高		681,700				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		29.0%				
乖離率		70.8%				

7月22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)(7/25~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(7/22~7/25)						
	8,460	8,460	▲0.450	▲0.450		
	389	389	▲0.450	▲0.450		

マネタリーベース [億円]
7月21日時点 6,721,100

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,870,200
7月25日以降の残り所要	
積数	5,000
平均	200

国庫短期証券入札予定

7月29日	3ヶ月(第1098回)
8月5日	3ヶ月
8月9日	6ヶ月
8月12日	3ヶ月
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

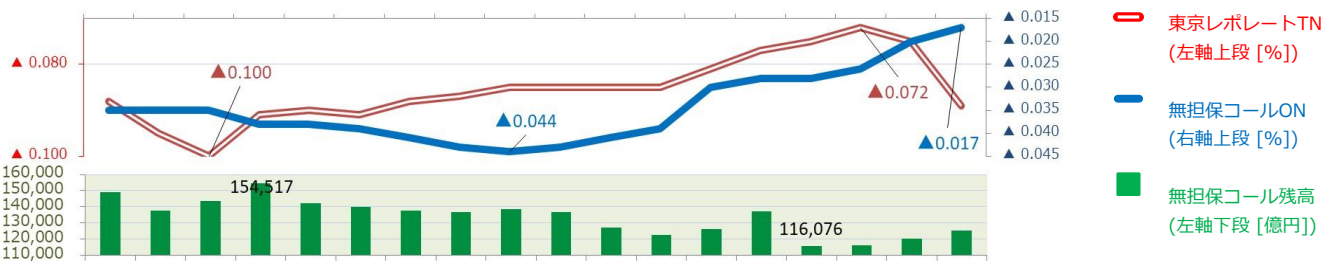
今月の国債買入オペ予定

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