



デイリーシグナル

2022年7月25日(月)

短期市場の推移

	7月19日	7月20日	7月21日	7月22日
加重平均金利	▲0.019	▲0.014	▲0.012	▲0.009
東京レポレート(TN)	▲0.098	▲0.138	▲0.186	▲0.155
無コール残	136,464	141,911	142,199	148,724
ON	73,586	77,028	74,251	76,811
その他	62,878	64,883	67,948	71,913
有コール残	29,625	30,053	31,577	30,944

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	▲0.010	▲0.095
T/N	▲0.009	▲0.008	▲0.009	▲0.123
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	0.000	▲0.006	▲0.139
2W	-	-	▲0.012	▲0.146
3W	-	-	-	▲0.150
1M	-	-	0.010	▲0.153
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.150
6M	-	-	-	▲0.149
1Y	-	-	-	▲0.144

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26日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	23:00 (米)7月消費者信頼感指数	97
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.007%の合出から始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.007%の水準で取引された。ビッドサイドの動向に大きな変化はなく、ON物加重平均金利(速報)は前日対比▲0.001%の▲0.010%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.015	- ~ -	▲0.010 ~ ▲0.007

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25日	7月26日	7月25日	7月26日	7月27日	7月28日
券		+300		▲500		▲3,000
財政		+25,100		+2,700		▲8,000
過不足		+25,400		+2,200		▲11,000
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
国債買入				+16,100		
CP等買入	▲100		▲600			
社債等買入			▲200			
国債補完供給	+8,900	▲8,400	+8,400			
当座預金増減		+25,800		+25,900		▲11,000
当座預金残高		5,506,500		5,532,400		5,521,400
準備預金残高		4,824,500				
積み終了先		4,823,800				
超過準備		4,823,800				
非準備先残高		682,000				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		32.3%				
乖離率		67.6%				

7月25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)(7/26~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(7/26~)						
1~3年	4,750	12,641	4,752	▲0.006	▲0.006	77.1
3~5年	4,750	13,616	4,755	▲0.020	▲0.019	55.2
5~10年	5,000	7,610	5,001	▲0.047	▲0.039	100.0
10~25年	1,250	6,108	1,259	▲0.037	▲0.035	10.9
国債補完供給(7/25~7/26)						
	8,244	8,244	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース	7月22日時点
7月22日時点	6,731,500

所要	今積期の所要準備額	7月26日以降の残り所要	積数	平均
今積期の所要準備額	3,870,200			
7月26日以降の残り所要			4,300	200

国債短期証券入札予定

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

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

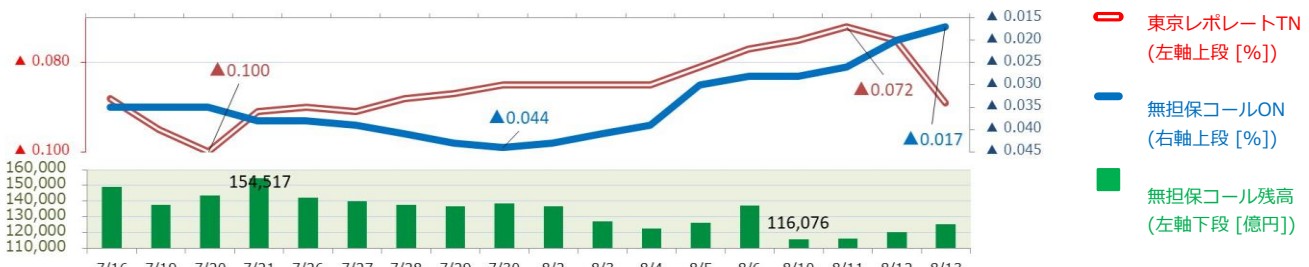
今月の国債買入オペ予定

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	0
1年超3年以下	4750	4,750	6 13 19 25	7月25日	0
3年超5年以下	4750	4,750	6 19 25 29	7月25日	1
5年超10年以下	5000	5,000	13 19 25 29	7月25日	1
10年超25年以下	1250	1,250	6 25	7月25日	0
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ありません。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