



デイリーシグナル

2022年7月27日(水)

短期市場の推移

	[億円] [%]			
	7月21日	7月22日	7月25日	7月26日
加重平均金利	▲0.012	▲0.009	▲0.010	▲0.010
東京レボレート(TN)	▲0.186	▲0.155	▲0.123	▲0.112
無コール残	142,199	148,724	155,796	158,051
ON	74,251	76,811	81,228	83,103
その他	67,948	71,913	74,568	74,948
有コール残	31,577	30,944	29,298	29,363

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	▲0.040	0.001	▲0.010	▲0.093
T/N	▲0.010	▲0.008	▲0.009	▲0.118
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	▲0.009	▲0.009	▲0.134
2W	-	-	▲0.025	▲0.137
3W	-	-	-	▲0.145
1M	-	-	0.001	▲0.149
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.150
6M	-	-	-	▲0.147
1Y	-	-	-	▲0.144

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28日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	3:00 (米)7月連邦公開市場委員会 (FOMC)政策金利	2.5%
-	-	21:30 (米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
-	-	21:30 (米)4-6月期国内総生産 (GDP) 速報値[前期比年率]	0.5%

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▲0.008%の合出から始まり、その後は主に▲0.012%~▲0.007%の水準で取引された。依然ビッドサイドの調達意欲に変化は見られず堅調であり、ON物加重平均金利(速報)も前日対比横ばいの▲0.010%であった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.012 ~ ▲0.010	- ~ -	▲0.012 ~ ▲0.007

翌営業日のマーケット

オファーサイド・ビッドサイド共に動向に変化は見られないため、本日対比横ばいの合出水準を想定する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月27日	7月28日	7月28日	7月29日	7月29日	7月29日
券	▲300	▲1,300	▲1,300	▲700	▲700	▲700
財政	▲9,100	+1,600	+1,600	▲700	▲700	▲700
過不足	▲9,400	+300	+300	▲1,400	▲1,400	▲1,400
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
国庫短期証券買入		+1,000				
CP等買入	▲600	▲200	▲200			+4,000
国債補完供給	+8,200	▲9,000	+9,000			
新型コロナ対応金融支援特別					▲123,500	
当座預金増減	▲9,800	+9,100	+9,100	▲120,900	▲120,900	▲120,900
当座預金残高	5,514,700	5,523,800	5,523,800	5,402,900	5,402,900	5,402,900
準備預金残高	4,842,400			主な需給要因		
積み終了先	4,841,700					
超過準備	4,841,700					
非準備預金残高	672,300					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	38.7%					
乖離率	61.2%					

7月27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)(7/28~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(7/27~7/28)	8,852	8,852	▲0.350	▲0.352		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
7月26日時点 6,775,400

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,870,200
7月28日以降の残り所要	
積数	2,900
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28日	2年
8月2日	10年
8月4日	物価連動
8月9日	30年

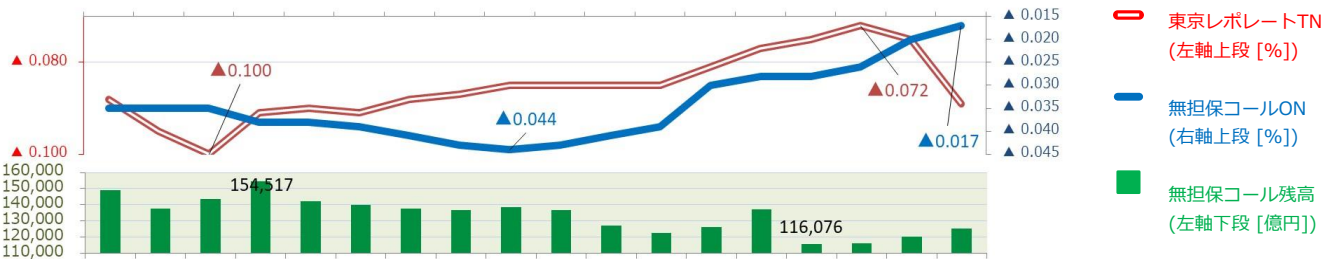
今月の国債買入オペ予定

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