



短期市場の推移

	6月27日	6月28日	6月29日	6月30日
加重平均金利	▲0.074	▲0.076	▲0.075	▲0.077
東京レポレート(TN)	▲0.086	▲0.087	▲0.086	▲0.085
無コール残	143,641	142,596	144,075	103,868
ON	69,541	69,846	73,525	57,643
その他	74,100	72,750	70,550	46,225
有コール残	29,179	30,494	30,603	29,424

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	▲0.087	0.001	▲0.071	▲0.078
T/N	-	-	-	▲0.081
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	0.005	▲0.054	▲0.092
2W	▲0.073	0.001	▲0.064	▲0.100
3W	-	-	-	▲0.110
1M	▲0.064	0.250	0.020	▲0.115
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.128
6M	-	-	-	▲0.131
1Y	-	-	-	▲0.102

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4日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	15:00	財政資金対民間収支の実績(6月)		
	-	-	-	-
	-	-	-	-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.075%の出合から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.070%の水準で取引された。月末に調達を控えていた先が再開したことで、出合水準は上昇しON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.006%の▲0.071%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.080	- ~ -	▲0.075 ~ ▲0.070

翌営業日のマーケット

オファービッド共に大きな動向変化はなく、出合いの水準は本日対比横ばい圏を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月3日	7月4日	7月4日	7月5日	7月5日	7月5日
券		+300		+100		▲2,000
財政		▲32,600		▲33,400		▲27,000
過不足		▲32,300		▲33,300		▲29,000
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		+14,100				
共通担保(全店)						▲8,900
CP等買入				▲200		
国債補完供給	+44,100	▲43,600	+43,600			
当座預金増減		▲17,700		+10,100		▲37,900
当座預金残高		5,426,800		5,436,900		5,399,000
準備預金残高		4,750,000	主な需給要因			
積み終了先		4,749,700	法人税・消費税揚げ	国債発行(10年)		
超過準備		4,749,700	・保険揚げ			
非準備先残高		676,800				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		60.0%				
乖離率		39.9%				

7月3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)(7/4~)						
5~10年	0	0	0			
5~10年	0	0	0			
国債補完供給(7/3~7/4)						
	43,582	43,582	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
6月30日時点 6,706,100

所要	今積期の所要準備額
7月4日以降の残り所要	3,883,300
積数	1,800
平均	200

国債短期証券入札予定

7月6日	6ヶ月(第1167回)
7月7日	3ヶ月(第1168回)
7月14日	3ヶ月
7月19日	1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	6月2日	1
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	5 10 14 20	6月23日	4
3年超5年以下	4,250~7,250	4,500	5 14 20 26	6月30日	4
5年超10年以下	4,750~8,750	5,750	10 14 20 26	6月30日	4
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	5 10 20 26	6月30日	4
25年超	500~3,500	1,000	10 14 26	6月30日	3
物価連動債	600	600	月1回	6月30日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	4月14日	1

1年前の市場推移

○2022年6月積み期 [6月16日~7月15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