



短期市場の推移

	6月28日	6月29日	6月30日	7月3日
加重平均金利	▲0.076	▲0.075	▲0.077	▲0.071
東京レポレート(TN)	▲0.087	▲0.086	▲0.085	▲0.081
無コール残	142,596	144,075	103,868	137,144
ON	69,846	73,525	57,643	77,459
その他	72,750	70,550	46,225	59,685
有コール残	30,494	30,603	29,424	31,134

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	▲0.060	▲0.077
T/N	-	-	-	▲0.077
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.058	▲0.088
2W	▲0.068	▲0.005	▲0.052	▲0.097
3W	-	-	-	▲0.106
1M	-	-	-	▲0.113
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.000	▲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5日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-			-	
	-			-	
	-			-	

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.060%の合出から始まり、その後は主に▲0.065%~▲0.050%の水準で取引された。ビッドサイドの調達意欲は旺盛であり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.011%の▲0.060%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.063 ~ ▲0.052	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.065 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲は強く、出合いの水準は本日対比上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月4日	7月5日	7月4日	7月5日	7月4日	7月5日
券		+200		+200		▲1,000
財政		▲34,000		▲31,700		+0
過不足		▲33,800		▲31,500		▲1,000
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
国庫短期証券買入				+1,000		
共通担保(全店)			▲8,900	+6,300		
CP等買入	▲200		▲200			
国債補完供給	+43,600	▲41,300	+41,300			
当座預金増減		▲31,700		+8,000		▲1,000
当座預金残高		5,395,100		5,403,100		5,402,100
準備預金残高		4,707,100				
積み終了先		4,706,800				
超過準備		4,706,800				
非準備先残高		688,000				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		63.3%				
乖離率		36.6%				

7月4日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(7/5~)	1,000	6,818	1,001	0.007	0.010	61.8
国債買入(固定利回り方式)(7/5~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(7/4~7/5)						
41,250	41,250	▲0.350	▲0.351			
53	53	▲0.350	▲0.350			
共通担保(全店)(7/5~7/19)	6,310	6,310				

マネタリーベース	所要
7月3日時点	6,688,100
今積期の所要準備額	3,883,300
7月5日以降の残り所要	
積数	1,600
平均	100

国庫短期証券入札予定

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

国債入札予定

7月6日	30年
7月11日	5年
7月13日	20年
7月25日	40年

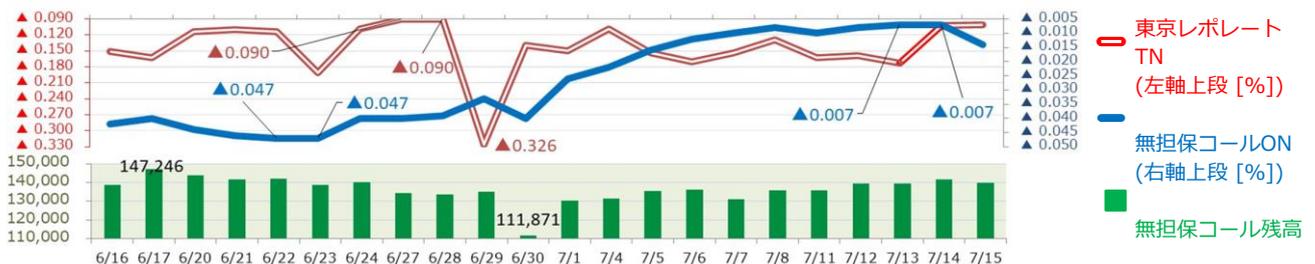
今月の国債買入オペ予定

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