



短期市場の推移

	6月29日	6月30日	7月3日	7月4日
加重平均金利	▲0.075	▲0.077	▲0.071	▲0.060
東京レポレート(TN)	▲0.086	▲0.085	▲0.081	▲0.077
無コール残	144,075	103,868	137,144	129,462
ON	73,525	57,643	77,459	67,407
その他	70,550	46,225	59,685	62,055
有コール残	30,603	29,424	31,134	29,343

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	▲0.032	▲0.074
T/N	-	-	-	▲0.077
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.033	▲0.088
2W	▲0.050	▲0.049	▲0.050	▲0.096
3W	-	-	-	▲0.103
1M	▲0.050	▲0.030	▲0.032	▲0.113
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.130
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6日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:15 (米) 6月のADP雇用統計	市場予想 前月比22.5万人増
-	-	(米) 週間の新規失業保険申請件数-	-
-	-	-	-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.035%の合出から始まり、その後は主に▲0.035%~▲0.030%の水準で取引された。昨日に引き続き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+0.028%の▲0.032%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.030	- ~ -	▲0.035 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

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5日	7月6日	7月6日	7月7日	7月7日	7月7日
券	+200		▲700		▲1,000	
財政	▲32,400		+2,800		▲8,000	
過不足	▲32,200		+2,100		▲9,000	
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				
国債買入				+12,400		
共通担保(全店)	▲8,900	+6,300				
CP等買入	▲200					
国債補充供給	+41,300	▲41,900	+41,900			
当座預金増減		▲34,600		+56,400		▲9,000
当座預金残高		5,360,500		5,416,900		5,407,900
準備預金残高		4,694,000				
積み終了先		4,693,800				
超過準備		4,693,800				
非準備先残高		666,500				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		66.7%				
乖離率		33.2%				

7月5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)(7/6~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(7/6~)						
~1年	1,500	6,255	1,504	0.004	0.006	58.8
1~3年	4,250	12,439	4,251	0.003	0.004	41.0
3~5年	4,500	9,962	4,508	0.001	0.003	23.0
10~25年	2,000	4,628	2,004	▲0.007	▲0.004	21.0
米ドル資金供給(7/7~7/13)						
	0	0	5,330	5,330		
国債補充供給(7/5~7/6)						
	41,837	41,837	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マネタリーベース (億円) 所要
 7月4日時点 6,656,300

所要 (億円)
 今積期の所要準備額 3,883,300
 7月6日以降の残り所要
 積数 1,300
 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	7月5日	0
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	5 10 14 20	7月5日	3
3年超5年以下	4,250~7,250	4,500	5 14 20 26	7月5日	3
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	7月5日	3
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]



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