



### 短期市場の推移

	6月30日	7月3日	7月4日	7月5日
加重平均金利	▲0.077	▲0.071	▲0.060	▲0.032
東京レポレート(TN)	▲0.085	▲0.081	▲0.077	▲0.077
無コール残	103,868	137,144	129,462	135,656
ON	57,643	77,459	67,407	69,646
その他	46,225	59,685	62,055	66,010
有コール残	29,424	31,134	29,343	31,125

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	▲0.016	▲0.071
T/N	-	-	-	▲0.074
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	▲0.021	▲0.030	▲0.086
2W	▲0.020	0.030	▲0.003	▲0.095
3W	-	-	▲0.018	▲0.103
1M	-	-	▲0.003	▲0.111
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.129
6M	-	-	-	▲0.133
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7日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30	(米)雇用統計
-	-	-	ECB総裁の講演
-	-	-	-

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.020%の合出から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.010%の水準で取引された。引き続きビッドサイドの調達意欲は強く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.016%の▲0.016%となった。

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

### 翌営業日のマーケット

週末3日積みでビッドサイドの調達意欲の一層の強まりが想定され、出合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6日	7月7日	7月7日	7月10日	7月10日	7月10日
券	▲700		+300		+1,000	
財政	+1,400		▲9,300		+2,000	
過不足	+700		▲9,000		+3,000	
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		+12,400				
CP等買入			▲100			
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+41,900	▲40,000	+40,000			
当座預金増減	+15,000		+30,800		+3,000	
当座預金残高	5,375,500		5,406,300		5,409,300	
準備預金残高	4,704,500		主な需給要因			
積み終了先	4,704,300		国債発行(30年)		国庫短期証券(3M)発行・償還	
超過準備	4,704,300				行・償還、国庫短期証券(6M)発行・償還	
非準備先残高	671,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	70.0%					
乖離率	29.9%					

### 7月6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)(7/7~)						
5~10年	0	0	0			
5~10年	0	0	0			
国債補完供給(7/6~7/7)						
	39,897	39,897	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

### マネタリーベース (億円)

7月5日時点 6,621,500

### 所要

今積期の所要準備額	3,883,300
7月7日以降の残り所要	
積数	1,100
平均	100

### 国庫短期証券入札予定

7月7日	3ヶ月(第1168回)
7月14日	3ヶ月
7月19日	1年
7月21日	3ヶ月
7月11日	5年
7月13日	20年
7月25日	40年
7月27日	2年

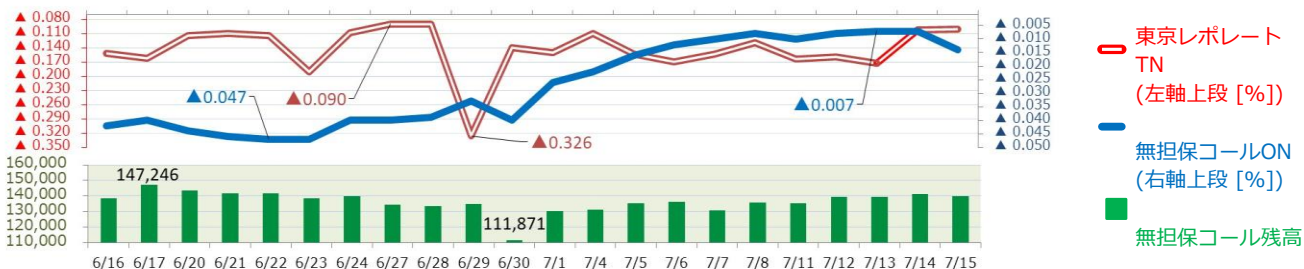
### 今月の国債買入オペ予定

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]

※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