



短期市場の推移

	7月3日	7月4日	7月5日	7月6日
加重平均金利	▲0.071	▲0.060	▲0.032	▲0.016
東京レポレート(TN)	▲0.081	▲0.077	▲0.077	▲0.074
無コール残	137,144	129,462	135,656	135,584
ON	77,459	67,407	69,646	67,744
その他	59,685	62,055	66,010	67,840
有コール残	31,134	29,343	31,125	32,244

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	▲0.012	▲0.067
T/N	-	-	-	▲0.064
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.045	▲0.076
2W	▲0.015	▲0.003	▲0.009	▲0.087
3W	-	-	0.060	▲0.095
1M	-	-	0.280	▲0.106
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.127
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10日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	14:00	さくらレポート		-
	-		-	
	-		-	

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.010%の出合から始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.008%の水準で取引された。週末3日積みで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+0.004%の▲0.012%となった。なお日本銀行は、7月10日に国債買現先オペを実施することを通知した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.010	▲0.010 ~ ▲0.010	▲0.015 ~ ▲0.008

翌営業日のマーケット

週末3日積み要因の剥落により出合水準は本日対比で若干の低下を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月7日	7月10日	7月10日	7月11日	7月11日	7月11日
券		+300		+500		+0
財政		▲12,800		+600		▲15,000
過不足		▲12,500		+1,100		▲15,000
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
CP等買入	▲100		▲300			
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+40,000	▲39,700	+39,700			
当座預金増減		▲12,400		+40,500		▲15,000
当座預金残高		5,363,100		5,403,600		5,388,600
準備預金残高		4,698,100	主な需給要因			
積み終了先		4,697,900	国庫短期証券(3M)	発行・償還	源泉税揚げ	
超過準備		4,697,900		発行・償還		
非準備先残高		665,000	国庫短期証券(6M)	発行・償還		
準備預金進捗率		99.9%				
平均		80.0%				
乖離率		19.9%				

7月7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)(7/10~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(7/7~7/10)						
	39,677	39,677	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
7月6日時点 6,637,200

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,888,200
7月10日以降の残り所要	
積数	400
平均	100

国庫短期証券入札予定

7月14日	3ヶ月(第1169回)
7月19日	1年
7月21日	3ヶ月
7月27日	3ヶ月

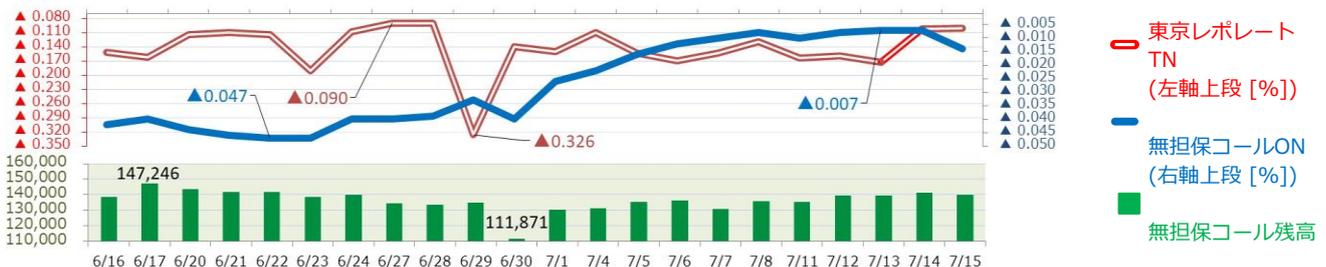
今月の国債買入オペ予定

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