



短期市場の推移

	7月4日	7月5日	7月6日	7月7日
加重平均金利	▲0.060	▲0.032	▲0.016	▲0.012
東京レボレート(TN)	▲0.077	▲0.077	▲0.074	▲0.064
無コール残	129,462	135,656	135,584	139,467
ON	67,407	69,646	67,744	70,977
その他	62,055	66,010	67,840	68,490
有コール残	29,343	31,125	32,244	32,264

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レボ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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.087	0.001	▲0.021	▲0.090
T/N	-	-	-	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.055	▲0.010	▲0.046	▲0.089
2W	-	-	-	▲0.096
3W	-	-	-	▲0.107
1M	-	-	-	▲0.117
2M	-	-	-	-
3M	0.001	0.030	0.014	▲0.129
6M	-	-	-	▲0.133
1Y	-	-	-	▲0.102

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

7月11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▲0.015%の合出から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.015%の水準で取引された。国債買現先オペの実施に伴い調達を慎重化させる動きが見られ、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.009%の▲0.021%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.020	- ~ -	▲0.025 ~ ▲0.015

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、合出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10日	7月11日	7月10日	7月11日	7月10日	7月11日
債券	+600		+400		▲1,000	
財政	+3,900		▲18,600		▲43,000	
過不足	+4,500		▲18,200		▲44,000	
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		
国債買現先		+10,000	▲10,000	+19,300	▲20,000	
CP等買入	▲300		▲100			
国債補完供給	+39,700	▲40,400	+40,400			
当座預金増減	+13,500		+45,500		▲64,000	
当座預金残高	5,376,600		5,422,100		5,358,100	
準備預金残高	4,698,800				主な需給要因	
積み終了先	4,698,700		源泉税揚げ		国債発行(5年)、源泉	
超過準備	4,698,700				税揚げ、労働保険揚	
非準備先残高	677,800				げ	
準備預金進捗率	99.9%					
平均	83.3%					
乖離率	16.6%					

7月10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
国債買現先・即日(7/10~7/11)	10,000	10,471	10,001	▲0.100	▲0.100	95.5
国債買現先(7/11~7/12)	20,000	50,000	20,003	▲0.100	▲0.092	9.1
国債買入(固定利回り方式)(7/11~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(7/11~)						
1~3年	4,250	12,260	4,252	0.004	0.005	77.8
5~10年	6,750	10,914	6,755	0.026	0.032	55.8
10~25年	2,000	3,368	2,001	0.052	0.057	94.1
25年~	1,000	2,291	1,004	0.056	0.059	77.4
国債補完供給(7/10~7/11)	40,556	40,556	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリベース	所要
7月7日時点	6,624,400
今積期の所要準備額	3,888,200
7月11日以降の残り所要	
積数	300
平均	100

国債短期証券入札予定

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
7月11日	5年
7月13日	20年
7月25日	40年
7月27日	2年

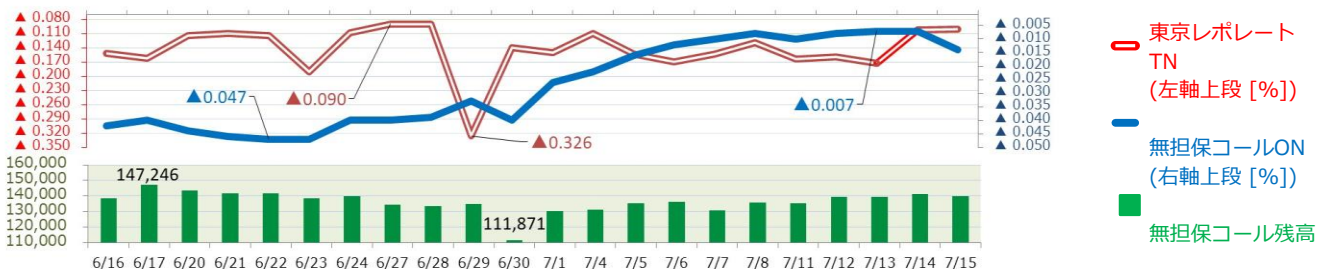
今月の国債買入オペ予定

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10日	2
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	6,750	10 14 20 26	7月10日	3
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	5 10 20 26	7月10日	2
25年超	500~3,500	1,000	10 14 26	7月10日	2
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