



短期市場の推移

	7月6日	7月7日	7月10日	7月11日
加重平均金利	▲0.016	▲0.012	▲0.021	▲0.026
東京レポレート(TN)	▲0.074	▲0.064	▲0.087	▲0.086
無コール残	135,584	139,467	161,871	156,697
ON	67,744	70,977	95,001	90,127
その他	67,840	68,490	66,870	66,570
有コール残	32,244	32,264	31,963	31,871

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	▲0.019	▲0.076
T/N	-	-	-	▲0.066
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.001	▲0.020	▲0.087
2W	-	-	▲0.039	▲0.092
3W	-	-	-	▲0.108
1M	-	-	-	▲0.114
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.131
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13日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-		21:30	(米)生産者物価(6月)	
	-			-	
	-			-	

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.020%の合から始まり、その後は主に▲0.025%~▲0.015%の水準で取引された。7/10オファターの国債買現先オペの影響が剥落したため、ビッドサイドの調達意欲は強くなり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.007%の▲0.019%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.017	- ~ -	▲0.025 ~ ▲0.010

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、出合の水準は本日対比上昇すると予定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月12日	7月13日	7月12日	7月13日	7月12日	7月13日
券		+600		▲700		▲2,000
財政		▲51,500		+3,100		▲9,000
過不足		▲50,900		+2,400		▲11,000
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				
国債買現先	▲19,300					
CP等買入			▲200			+4,000
社債等買入	▲100					
国債補充供給	+55,600	▲44,100	+44,100			
当座預金増減		▲57,800		+46,300		▲7,000
当座預金残高		5,305,400		5,351,700		5,344,700
準備預金残高		4,667,700	主な需給要因			
積み終了先		4,667,600				
超過準備		4,667,600				
非準備先残高		637,700				国債発行(20年)
準備預金進捗率		99.9%				
平均		90.0%				
乖離率		9.9%				

7月12日のオペ結果

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファター	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(固定利回り方式)(7/13~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(7/12~7/13)						
	44,178	44,178	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
7月11日時点 6,623,500

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,888,600
7月13日以降の残り所要	
積数	200
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(第1170回)
7月21日	3ヶ月
7月27日	3ヶ月

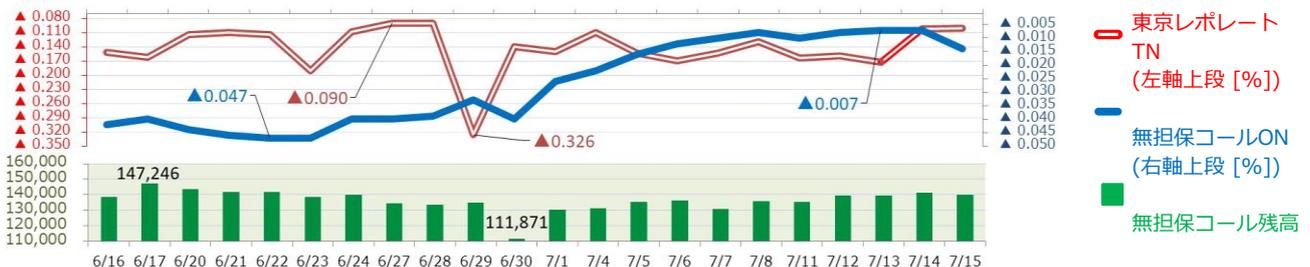
今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオファター金額	直近オファター額	オファター予定日	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
物価運動債	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