



短期市場の推移

	7月7日	7月10日	7月11日	7月12日
加重平均金利	▲0.012	▲0.021	▲0.026	▲0.019
東京レポレート(TN)	▲0.064	▲0.087	▲0.086	▲0.066
無コール残	139,467	161,871	156,697	163,987
ON	70,977	95,001	90,127	94,107
その他	68,490	66,870	66,570	69,880
有コール残	32,264	31,963	31,871	32,720

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	▲0.009	▲0.087
T/N	-	-	-	▲0.083
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	▲0.030	▲0.042	▲0.093
2W	▲0.050	0.030	▲0.023	▲0.097
3W	-	-	-	▲0.108
1M	-	-	-	▲0.117
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.132
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14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▲0.008%の出合から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.001%の水準で取引された。6月積み期終盤のビッドサイドの調達ニーズの強まりにより、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.010%の▲0.009%となった。また日本銀行は翌営業日スタートの国債買現先オベを4兆円オファーした。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.008	- ~ -	▲0.008 ~ ▲0.001

翌営業日のマーケット

新積み期にかかる4日積みであり、調達を見送る先も想定され、出合の水準は本日対比低下すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月13日		7月14日		7月18日	
券	▲800		+200		+2,000	
財政	+2,000		▲9,500		+8,000	
過不足	+1,200		▲9,300		+10,000	
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
国債買現先				+38,100	▲40,000	
CP等買入	▲200		▲200	+4,000		
社債等買入			▲2,200			
国債補完供給	+44,100	▲42,000	+42,000			
当座預金増減	+3,100		+72,400		▲30,000	
当座預金残高	5,308,500		5,380,900		5,350,900	
準備預金残高	4,639,700		4,639,600		主な需給要因	
積み終了先			国債発行(20年)発行		個人向け国債発行・償還、国庫短期証券発行・償還(3M)	
超過準備	4,639,600					
非準備先残高	668,800					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	93.3%					
乖離率	6.6%					

7月13日のオベ結果

オベ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買現先(7/14~7/18)	40,000	71,350	40,003	▲0.100	▲0.094	34.6
国債買入(固定利回り方式)(7/14~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(7/13~7/14)	42,335	42,335	▲0.350	▲0.352		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
7月12日時点 6,565,100

所要	今積期の所要準備額
7月14日以降の残り所要	3,888,600
積数	100
平均	0

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(第1170回)
7月21日	3ヶ月
7月27日	3ヶ月

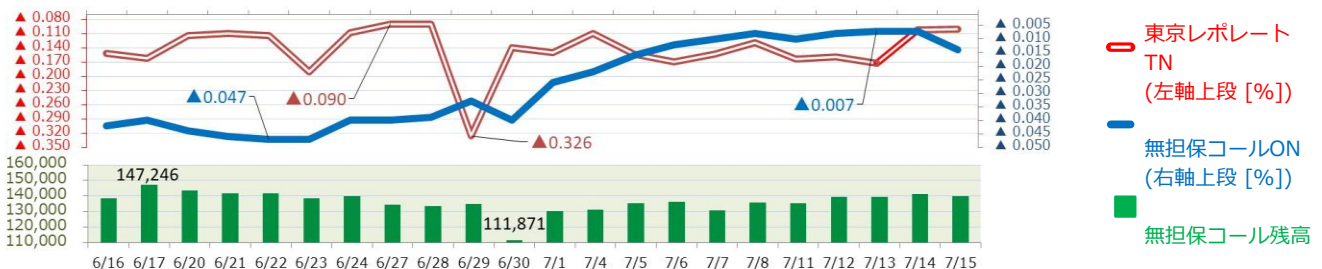
今月の国債買入オベ予定

オベ種類	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