



短期市場の推移

	7月10日	7月11日	7月12日	7月13日
加重平均金利	▲0.021	▲0.026	▲0.019	▲0.009
東京レポレート(TN)	▲0.087	▲0.086	▲0.066	▲0.083
無コール残	161,871	156,697	163,987	163,490
ON	95,001	90,127	94,107	95,760
その他	66,870	66,570	69,880	67,730
有コール残	31,963	31,871	32,720	31,429

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	▲0.021	▲0.076
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.055	▲0.019	▲0.034	▲0.091
2W	▲0.050	0.001	▲0.018	▲0.098
3W	-	-	-	▲0.110
1M	-	-	▲0.010	▲0.118
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.134
6M	-	-	-	▲0.134
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18日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) 6月小売売上高	-
-	-	(米) 6月鉱工業生産	-
-	-	-	-

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▲0.025%~▲0.015%の水準で取引された。6月積み期最終営業日のため調達量を抑制する先も一部見られ、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.012%の▲0.021%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.035 ~ ▲0.035	- ~ -	▲0.030 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

新積み期の初取引のため、調達サイドの慎重姿勢が強く見られ出合水準は本日対比低下を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月14日	7月18日	7月18日	7月19日	7月19日	7月19日
券	+200	+300	+300	+1,000		
財政	▲9,800	+7,800	+7,800	+7,000		
過不足	▲9,600	+8,100	+8,100	+8,000		
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				+16,700		
国債買現先		+38,100	▲38,100			
CP等買入	▲200	+4,000	▲700			
社債等買入	▲2,200		▲100			
国債補充供給	+42,000	▲47,900	+47,900			
当座預金増減	+24,200	+33,800	+33,800	+8,000		
当座預金残高	5,332,700	5,366,500	5,366,500	5,374,500		
準備預金残高	4,652,600	主な需給要因				
積み終了先	4,652,600	個人向け国債				
超過準備	4,652,600	発行・償還				
非準備先残高	680,100	国庫短期証券				
準備預金進捗率	100.0%	発行・償還(3M)				
平均	100.0%					
乖離率	0.0%					

7月14日のオペ結果

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)(7/18~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(7/18~)						
1~3年	4,250	8,214	4,251	▲0.001	0.000	79.7
3~5年	4,500	7,433	4,500	0.002	0.007	26.7
5~10年	6,750	12,863	6,758	0.005	0.012	9.1
25年~	1,000	1,697	1,000	0.028	0.035	18.7
国債補充供給(7/14~7/18)						
	48,117	48,117	▲0.350	▲0.351		
	57	57	▲0.350	▲0.359		

マナタリベース	所要
7月13日時点 6,569,000	来積み期の所要準備額 4,015,900
	7月18日以降の残り所要
	積数 107,200
	平均 3,700

国庫短期証券入札予定

7月19日	1年(第1170回)
7月21日	3ヶ月(第1171回)
7月27日	3ヶ月
8月4日	3ヶ月
7月25日	40年
7月27日	2年
8月1日	10年
8月3日	物価運動

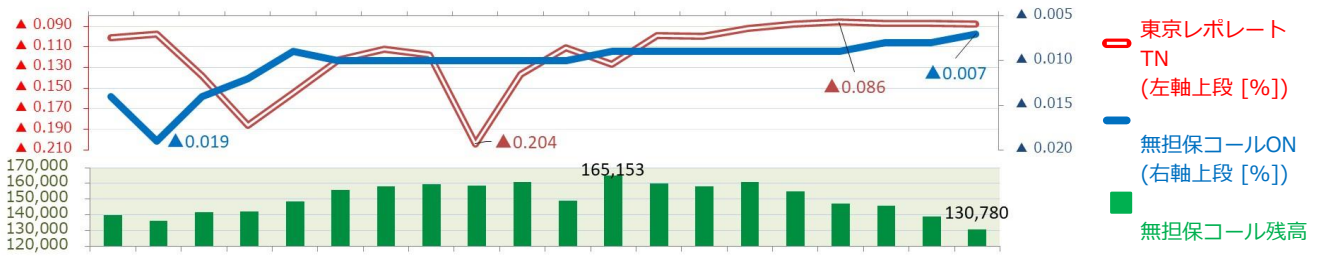
今月の国債買入オペ予定

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14日	1
3年超5年以下	4,250~7,250	4,500	5 14 20 26	7月14日	2
5年超10年以下	4,750~8,750	6,750	10 14 20 26	7月14日	2
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14日	1
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7月積み期 [7月15日~8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