



短期市場の推移

	7月11日	7月12日	7月13日	7月14日
加重平均金利	▲0.026	▲0.019	▲0.009	▲0.021
東京レボレート(TN)	▲0.086	▲0.066	▲0.083	▲0.085
無コール残	156,697	163,987	163,490	141,251
ON	90,127	94,107	95,760	79,101
その他	66,570	69,880	67,730	62,150
有コール残	31,871	32,720	31,429	32,863

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	▲0.048	▲0.087
T/N	-	-	-	▲0.090
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.058	▲0.040	▲0.051	▲0.096
2W	▲0.060	▲0.010	▲0.040	▲0.103
3W	-	-	-	▲0.109
1M	▲0.055	0.001	▲0.046	▲0.120
2M	-	-	0.001	-
3M	-	-	-	▲0.133
6M	-	-	-	▲0.135
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19日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 (米)	6月住宅着工件数
-	-	(欧)	6月消費者物価指数(確報)
-	-	-	-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.040%の合出から始まり、その後は主に▲0.055%~▲0.045%の水準で取引された。積み初のため、取り手の様子見姿勢が強く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.027%の▲0.048%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.055	- ~ -	▲0.055 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

調達サイドの慎重姿勢が継続され出合水準は本対比横ばい圏から低下を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月18日	7月19日	7月18日	7月19日	7月20日	7月21日
券		+200		+500		▲1,000
財政		+12,400		+9,400		▲2,000
過不足		+12,600		+9,900		▲3,000
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					
共通担保(全店)			▲6,300	+9,000		
CP等買入	▲700					
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+47,900	▲47,000	+47,000			
当座預金増減		▲8,700		+59,600		▲3,000
当座預金残高		5,324,000		5,383,600		5,380,600
準備預金残高		4,635,600				
積み終了先		4,618,000				
超過準備		4,594,500				
非準備先残高		688,400				
準備預金進捗率		98.4%				
平均		9.7%				
乖離率		88.7%				

7月18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)(7/19~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(7/20~7/27)						
			0	5,330	5,330	
国債補完供給(7/18~7/19)						
	47,403	47,403	▲0.350	▲0.351		
	0	0				
共通担保(全店)(7/19~8/2)						
	8,970	8,970				

マネタリーベース [億円]

7月14日時点 6,592,900

所要

今積期の所要準備額	4,015,900
7月19日以降の残り所要	
積数	66,100
平均	2,400

国債短期証券入札予定

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

国債入札予定

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

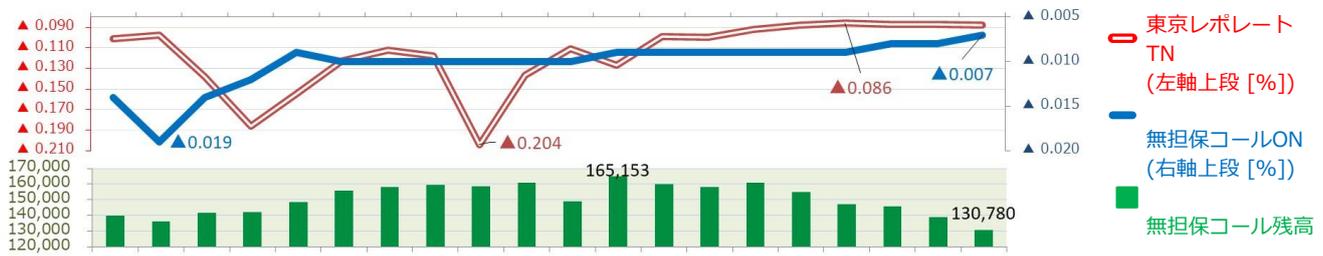
今月の国債買入オペ予定

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