



### 短期市場の推移

	7月12日	7月13日	7月14日	7月18日
加重平均金利	▲0.019	▲0.009	▲0.021	▲0.048
東京レボレート(TN)	▲0.066	▲0.083	▲0.085	▲0.090
無コール残	163,987	163,490	141,251	136,787
ON	94,107	95,760	79,101	73,499
その他	69,880	67,730	62,150	63,288
有コール残	32,720	31,429	32,863	29,986

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	▲0.052	▲0.088
T/N	-	-	-	▲0.091
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.065	▲0.009	▲0.059	▲0.097
2W	▲0.060	▲0.040	▲0.054	▲0.106
3W	-	-	▲0.050	▲0.111
1M	-	-	-	▲0.122
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.133
6M	-	-	-	▲0.136
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20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▲0.055%の合出から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.050%の水準で取引された。調達サイドの慎重姿勢が継続する中、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.004%の▲0.052%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.060	- ~ -	▲0.060 ~ ▲0.040

### 翌営業日のマーケット

オファービッド動向に大きな変化はなく出合水準は本日対比横ばいを予想する。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月19日	7月20日	7月20日	7月21日	7月21日	7月22日
券	+600	▲200				+0
財政	+5,100	+4,100				+2,000
過不足		+5,700		+3,900		+2,000
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
共通担保(全店)	▲6,300	+9,000				
CP等買入			▲200			
社債等買入			▲300			
国債補完供給	+47,000	▲41,400	+41,400			
気候変動対応					▲16,000	
当座預金増減		+14,000	+44,800			▲14,000
当座預金残高		5,338,000	5,382,800			5,368,800
準備預金残高		4,651,600				
積み終了先		4,637,100				
超過準備		4,635,200				
非準備先残高		686,400				
準備預金進捗率		98.8%				
平均		12.9%				
乖離率		85.9%				

### 7月19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
国債買入(固定利回り方式)(7/20~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
社債等買入(7/24~)						
	1,000	2,074	1,002	0.220	0.236	25.9
国債補完供給(7/19~7/20)						
	41,677	41,677	▲0.350	▲0.352		
	38	38	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)  
7月18日時点 6,584,000

所要	(億円)
今積期の所要準備額	4,015,900
7月20日以降の残り所要	
積数	49,700
平均	1,800

### 国債短期証券入札予定

7月21日	3ヶ月(第1171回)
7月27日	3ヶ月
8月4日	3ヶ月
8月9日	6ヶ月

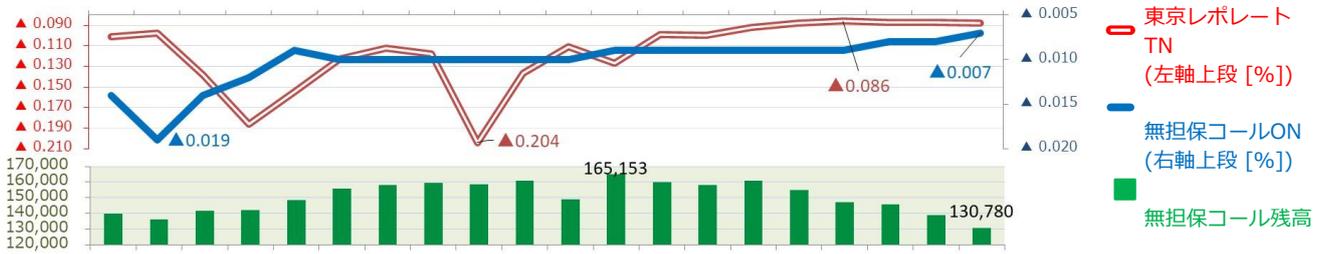
### 今月の国債買入オペ予定

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