



短期市場の推移

	7月13日	7月14日	7月18日	7月19日
加重平均金利	▲0.009	▲0.021	▲0.048	▲0.052
東京レボレート(TN)	▲0.083	▲0.085	▲0.090	▲0.091
無コール残	163,490	141,251	136,787	150,935
ON	95,760	79,101	73,499	83,347
その他	67,730	62,150	63,288	67,588
有コール残	31,429	32,863	29,986	29,655

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	▲0.061	▲0.086
T/N	-	-	-	▲0.093
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.065	▲0.059	▲0.064	▲0.099
2W	▲0.059	▲0.005	▲0.033	▲0.104
3W	-	-	-	▲0.111
1M	-	-	▲0.055	▲0.119
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.480	▲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21日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	6月全国消費者物価(総務省)	市場予想 コア前年比3.3% 上昇			

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.060%の合出から始まり、その後は主に▲0.070%~▲0.055%の水準で取引された。昨日に引き続きビッドサイドの調達ニーズは弱く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.009%の▲0.061%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.070	- ~ -	▲0.065 ~ ▲0.055

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弱く、出会い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20日	7月21日	7月21日	7月22日	7月24日	7月25日
券	▲200	▲200	▲200	▲200	+1,000	+1,000
財政	+3,200	▲1,300	▲1,300	▲1,300	+11,000	+11,000
過不足	+3,000	▲1,500	▲1,500	▲1,500	+12,000	+12,000
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				▲17,600		
CP等買入	▲200		▲400			
社債等買入	▲300		▲100			+1,000
国債補完供給	+41,400	▲40,800	+40,800			
気候変動対応			▲16,000	+34,400		
当座預金増減	+3,100	+74,800	+74,800	+74,800	+13,000	+13,000
当座預金残高	5,341,100	5,415,900	5,415,900	5,415,900	5,428,900	5,428,900
準備預金残高	4,646,000					
積み終了先	4,638,200					
超過準備	4,636,100					
非準備先残高	695,100					
準備預金進捗率	99.0%					
平均	16.1%					
乖離率	82.9%					

7月20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)(7/21~)						
5~10年	0	0	0			
5~10年	0	0	0			
国債買入(7/21~)						
1~3年	4,250	8,104	4,255	▲0.003	▲0.002	68.7
3~5年	4,500	10,302	4,505	▲0.007	▲0.005	6.4
5~10年	6,750	12,668	6,753	▲0.011	▲0.006	19.9
10~25年	2,000	3,632	2,003	▲0.017	▲0.014	39.8
国債補完供給(7/20~7/21)						
	41,084	41,084	▲0.350	▲0.352		
	0	0				
気候変動対応(7/21~7/19)						
	34,398	34,398				

マネタリーベース

7月19日時点 6,597,400

所要

今積期の所要準備額	4,015,900
7月21日以降の残り所要	
積数	39,800
平均	1,500

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(第1172回)
8月4日	3ヶ月
8月9日	6ヶ月
7月25日	40年
7月27日	2年
8月1日	10年
8月3日	物価連動

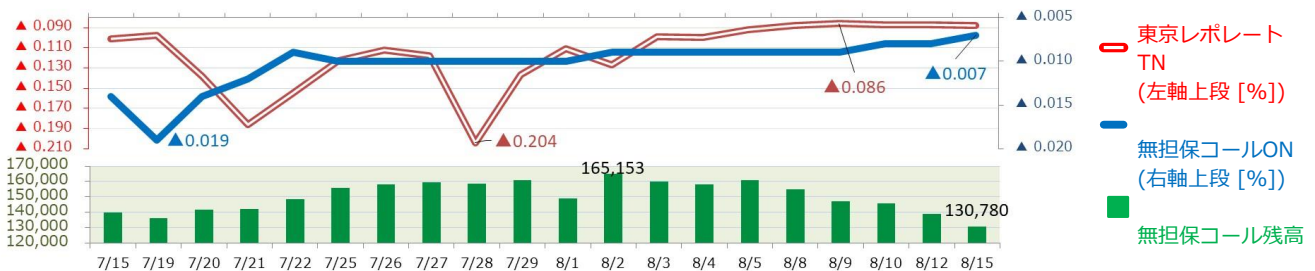
今月の国債買入オペ予定

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20日	0
3年超5年以下	4,250~7,250	4,500	5 14 20 26	7月20日	1
5年超10年以下	4,750~8,750	6,750	10 14 20 26	7月20日	1
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	5 10 20 26	7月20日	1
25年超	500~3,500	1,000	10 14 26	7月14日	1
物価連動債	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