



短期市場の推移

	7月14日	7月18日	7月19日	7月20日
加重平均金利	▲0.021	▲0.048	▲0.052	▲0.061
東京レポレート(TN)	▲0.085	▲0.090	▲0.091	▲0.093
無コール残	141,251	136,787	150,935	147,371
ON	79,101	73,499	83,347	78,983
その他	62,150	63,288	67,588	68,388
有コール残	32,863	29,986	29,655	30,290

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	▲0.070	▲0.093
T/N	-	-	-	▲0.096
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.075	▲0.055	▲0.071	▲0.103
2W	-	-	▲0.003	▲0.106
3W	-	-	-	▲0.113
1M	-	-	-	▲0.122
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.132
6M	-	-	-	▲0.136
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24日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) FOMC	-
-	-	-	-
-	-	-	-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.070%の出合から始まり、その後は主に▲0.080%~▲0.070%の水準で取引された。先週に引き続きビッドサイドの調達姿勢は変わらず、レートを大幅に上げてまで調達する先は見られずON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.003%の▲0.073%となった。

都銀・信託	証券	地銀
~	~	▲0.080 ~ ▲0.070

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの動態に変化は見られず、本日対比横ばい圏から若干の低下を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月21日	7月24日	7月24日	7月25日	7月25日	7月25日
券	▲100		+300	+1,000		
財政	▲1,900		+8,300	+12,000		
過不足	▲2,000		+8,600	+13,000		
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	▲400		▲400			
社債等買入	▲100		▲100	+1,000		
国債補完供給	+40,800	▲40,100	+40,100			
気候変動対応	▲16,000	+34,400				
当座預金増減	+34,200		+49,200	+13,000		
当座預金残高	5,375,300		5,424,500	5,437,500		
準備預金残高	4,682,500		主な需給要因			
積み終了先	4,680,300		流動性供給、国庫短	各種財政資金の支払		
超過準備	4,678,200		期証券発行・償還	い		
非準備先残高	692,800		(3M)、各種財政資金の支払い			
準備預金進捗率	99.3%					
平均	25.8%					
乖離率	73.5%					

7月21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)(7/24~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(7/21~7/24)						
	40,362	40,362	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
7月20日時点 6,600,700

所要	今積期の所要準備額	7月24日以降の残り所要
	4,015,900	
積数		26,700
平均		1,200

国債短期証券入札予定

7月27日	3ヶ月(第1172回)
8月4日	3ヶ月
8月9日	6ヶ月
8月10日	3ヶ月

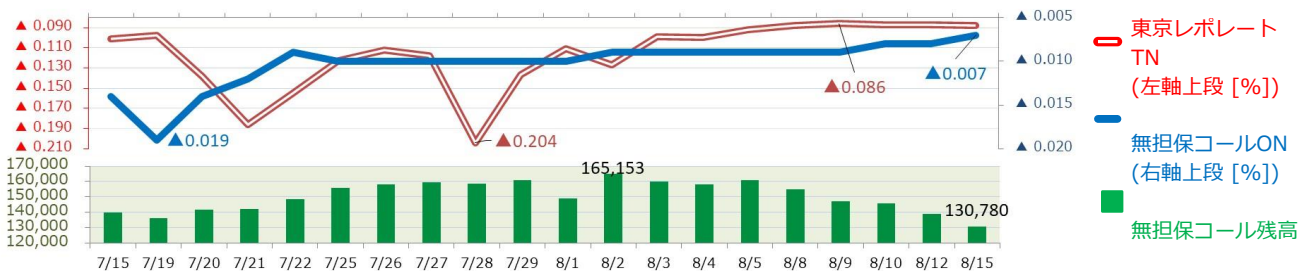
今月の国債買入オペ予定

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