



短期市場の推移

	7月24日	7月25日	7月26日	7月27日
加重平均金利	▲0.073	▲0.074	▲0.073	▲0.071
東京レポレート(TN)	▲0.100	▲0.097	▲0.097	▲0.097
無コール残	155,303	147,873	148,124	163,002
ON	81,320	71,740	69,686	87,164
その他	73,983	76,133	78,438	75,838
有コール残	31,149	31,048	31,744	31,084

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	▲0.059	▲0.093
T/N	-	-	-	▲0.099
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.107
2W	▲0.058	0.001	▲0.051	▲0.112
3W	-	-	-	▲0.116
1M	▲0.023	▲0.005	▲0.017	▲0.119
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.128
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31日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀の金融政策決定会合 事録等 (13年1月~6月)			
-		-	
-		-	

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.060%の出合から始まり、その後は主に▲0.065%~▲0.050%の水準で取引された。ビッドサイドの調達意欲の高まりもあり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.012%の▲0.059%となった。また、本日開催された金融政策決定会合では、長短金利操作の運用が柔軟化され、指値オペの利回り水準が1.0%へ引き上げられることが決定された。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.065 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達意欲は強く、出合水準は本日対比上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	7月28日	7月29日	7月31日	8月1日	8月1日
券		▲500		+600	+1,000
財政		+9,100		+11,400	▲13,000
過不足		+8,600		+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
国債買入				+8,400	
CP等買入	▲200		▲1,800	+4,000	
社債等買入	▲100				
国債補充供給	+45,100	▲46,600	+46,600		
当座預金増減		+6,800	+69,200	▲12,000	
当座預金残高		5,405,700	5,474,900	5,462,900	
準備預金残高		4,699,800			主な需給要因
積み終了先		4,698,200	国庫短期証券発行・償還	国債発行・償還	
超過準備		4,698,000	還(3M)	(2年)	
非準備先残高		705,900			
準備預金進捗率		99.7%			
平均		48.4%			
乖離率		51.3%			

7月28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)(7/31~)						
5~10年	8,429	8,429				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(7/28~7/31)						
	46,640	46,640	▲0.350	▲0.351		
	38	38	▲0.350	▲0.350		

マナリーベース (億円)
7月27日時点 6,659,500

所要	(億円)
今積期の所要準備額	4,015,900
7月31日以降の残り所要	
積数	13,300
平均	800

国庫短期証券入札予定

8月4日	3ヶ月(第1173回)
8月9日	6ヶ月
8月10日	3ヶ月
8月17日	1年
8月1日	10年
8月3日	物価連動
8月8日	30年
8月15日	5年

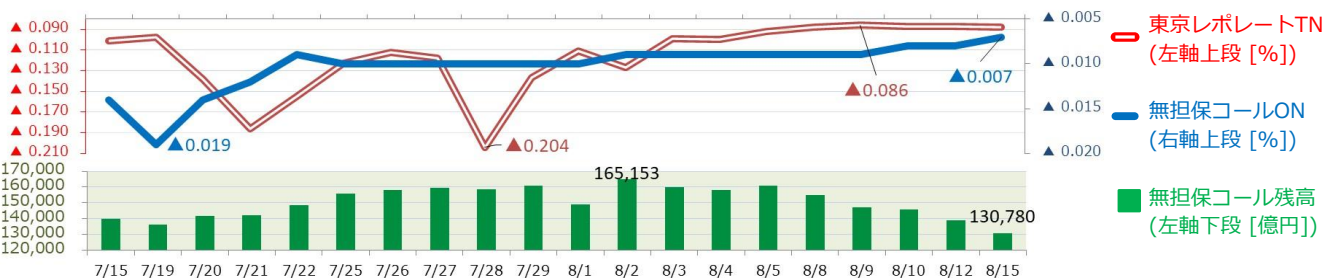
今月の国債買入オペ予定

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26日	0
5年超10年以下	4,750~8,750	6,750	10 14 20 26	7月26日	0
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	5 10 20 26	7月26日	0
25年超	500~3,500	1,000	10 14 26	7月26日	0
物価連動債	600	600	月1回	7月26日	0
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	4月14日	0

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