



### 短期市場の推移

	6月28日	6月29日	6月30日	7月1日
加重平均金利	▲0.039	▲0.033	▲0.040	▲0.026
東京レポレート(TN)	▲0.090	▲0.326	▲0.139	▲0.150
無コール残	133,677	135,062	111,871	130,510
ON	55,739	58,287	72,196	68,925
その他	77,938	76,775	39,675	61,585
有コール残	29,934	28,387	25,113	25,584

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	▲0.055	0.001	▲0.022	▲0.095
T/N	-	-	▲0.015	▲0.109
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.024	▲0.137
2W	▲0.045	▲0.003	▲0.024	▲0.143
3W	-	-	-	▲0.146
1M	▲0.045	▲0.025	▲0.029	▲0.149
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.144
6M	-	-	-	▲0.134
1Y	-	-	-	▲0.129

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5日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	日銀当座預金増減要因 (7月見込み)		(米) 5月の製造業受注		
	-		-		
	-		-		

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.020%の合出から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.015%の水準で取引された。都銀・信託を中心に資金調達ニーズが高く、無担保コールON物加重平均金利(速報)は前日対比+0.004%の▲0.022%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.020	▲0.030 ~ ▲0.025	▲0.035 ~ ▲0.015

### 翌営業日のマーケット

引き続き資金調達ニーズは底堅く、出合水準は本日対比やや上昇を予想する。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月4日	7月5日	7月5日	7月6日	7月6日	7月6日
券		+600		▲100		▲1,000
財政		▲38,800		+400		▲27,000
過不足		▲38,200		+300		▲28,000
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)					▲4,500	
社債等買入				▲100		
E T F買入		+600		+300		
国債補完供給	+19,800	▲15,900	+15,900			
当座預金増減		▲33,700		+16,400		▲32,500
当座預金残高		5,486,200		5,502,600		5,470,100
準備預金残高		4,806,100	主な需給要因			
積み終了先		4,806,100	国債発行(10年)			
超過準備		4,806,000				
非準備先残高		680,100				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		63.3%				
乖離率		36.6%				

### 7月4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)(7/5~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(7/4~7/5)						
	15,323	15,323	▲0.450	▲0.450		
	500	500	▲0.450	▲0.450		

マネタリーベース [億円]  
7月1日時点 6,771,200

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,743,800
7月5日以降の残り所要	
積数	200
平均	0

### 国債短期証券入札予定

7月7日	6ヶ月(第1092回)
7月8日	3ヶ月(第1093回)
7月15日	3ヶ月
7月19日	1年

### 国債入札予定

7月5日	10年
7月7日	30年
7月12日	5年
7月14日	20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	6月3日	1
1年超3年以下	4750	4,750	6 13 19 25	6月22日	4
3年超5年以下	4750	4,750	6 19 25 29	6月29日	4
5年超10年以下	5000	5,000	13 19 25 29	6月29日	4
10年超25年以下	1250	1,250	6 25	6月29日	2
25年超	500	500	13 29	6月22日	2
物価連動債	600	600	月1回	6月29日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	4月8日	1

### 1年前の市場推移

○2021年6月積み期 [6月16日~7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