



### 短期市場の推移

	[億円] [%]			
	6月29日	6月30日	7月1日	7月4日
加重平均金利	▲0.033	▲0.040	▲0.026	▲0.022
東京レボレート(TN)	▲0.326	▲0.139	▲0.150	▲0.109
無コール残	135,062	111,871	130,510	131,525
ON	58,287	72,196	68,925	64,370
その他	76,775	39,675	61,585	67,155
有コール残	28,387	25,113	25,584	29,879

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	▲0.050	0.001	▲0.016	▲0.147
T/N	-	-	▲0.015	▲0.153
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	▲0.012	▲0.016	▲0.159
2W	▲0.030	▲0.020	▲0.024	▲0.159
3W	-	-	▲0.025	▲0.159
1M	-	-	▲0.047	▲0.161
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.150	▲0.146
6M	-	-	-	▲0.135
1Y	-	-	-	▲0.130

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6日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)6月ISM非製造業景況指数	54.2
-	-	-	-
-	-	-	-

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.020%の出合から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.010%の水準で取引された。先日に引き続きビットサイドの資金調達ニーズは高く、無担保コールON物加重平均金利(速報)は前日対比+0.006%の▲0.016%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.015	▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.030 ~ ▲0.010

### 翌営業日のマーケット

ビットサイドの資金調達ニーズは底堅く推移しており、出合水準は本日対比若干の上昇を予想する。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月5日		7月6日		7月7日	
券	▲200		+400		▲1,000	
財政	+3,000		▲28,500		+3,000	
過不足	+2,800		▲28,100		+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
国庫短期証券買入				+1,000		
共通担保(全店)			▲4,500	+3,100		
CP等買入			▲100			
社債等買入	▲100					
E T F買入		+300				
国債補完供給	+15,900	▲16,900	+16,900			
当座預金増減	+2,000		▲11,700		+2,000	
当座預金残高	5,488,200		5,476,500		5,478,500	
準備預金残高	4,810,000		主な需給要因			
積み終了先	4,810,000		国債発行(10Y)			
超過準備	4,810,000					
非準備先残高	678,200					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	66.7%					
乖離率	33.2%					

### 7月5日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(7/6~)	1,000	4,994	1,000	0.020	0.020	
国債買入(固定利回り方式)(7/6~)						
5~10年		0	0			
5~10年		0	0			
米ドル資金供給(7/7~7/14)						
		0	0	1.840	1.840	
国債補完供給(7/5~7/6)						
	16,871	16,871	▲0.350	▲0.350		
	0	0				
共通担保(全店)(7/6~7/20)						
	20,000	3,051	3,051			

マナタリーベース [億円]  
7月4日時点 6,736,800

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,743,800
7月6日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

### 国庫短期証券入札予定

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

### 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