



短期市場の推移

	7月4日	7月5日	7月6日	7月7日
加重平均金利	▲0.022	▲0.016	▲0.012	▲0.010
東京レポレート(TN)	▲0.109	▲0.153	▲0.170	▲0.153
無コール残	131,525	135,413	136,262	131,087
ON	64,370	67,018	67,164	60,889
その他	67,155	68,395	69,098	70,198
有コール残	29,879	27,701	30,555	29,597

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	▲0.045	0.001	▲0.008	▲0.104
T/N	-	-	▲0.010	▲0.129
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.005	▲0.027	▲0.152
2W	-	-	-	▲0.155
3W	-	-	-	▲0.157
1M	▲0.030	0.100	0.035	▲0.161
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.000	▲0.151
6M	-	-	-	▲0.137
1Y	-	-	-	▲0.133

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11日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:00	日銀支店長会議		(欧) ユーロ圏財務相会合	
14:00	日銀地域経済報告 (さくらレポート)		-	
	-		-	

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▲0.005%の合出から始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.004%の水準で取引された。週末3日積みのため調達ニーズは一層強まり、無担保コールON物加重平均金利(速報)は前日対比+0.002%の▲0.008%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.015 ~ ▲0.006	▲0.005 ~ ▲0.005	▲0.010 ~ ▲0.004

翌営業日のマーケット

調達ニーズはやや落ち着き、合出水準は本日対比でやや低下を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月8日	7月11日	7月11日	7月12日	7月12日	7月12日
券	+100	+800	+800	+500	+500	+500
財政	+600	+4,000	+4,000	+2,000	+2,000	+2,000
過不足	+700	+4,800	+4,800	+2,500	+2,500	+2,500
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
CP等買入	▲100	▲100	▲100			
国債補充供給	+13,900	+13,400	+13,400			
当座預金増減	+1,100	+18,100	+18,100	+2,500	+2,500	+2,500
当座預金残高	5,477,000	5,495,100	5,495,100	5,497,600	5,497,600	5,497,600
準備預金残高	4,793,500	主な需給要因				
積み終了先	4,793,500	国庫短期証券				
超過準備	4,793,500	発行・償還				
非準備先残高	683,500	(3M・6M)				
準備預金進捗率	99.9%					
平均	83.3%					
乖離率	16.6%					

7月8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)(7/11~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
CP等買入(7/13~)						
	4,000	10,965	3,981	▲0.001	0.000	18.6
国債補充供給(7/8~7/11)						
	13,314	13,314	▲0.450	▲0.450		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
7月7日時点 6,727,000

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,746,400
7月11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15日	3ヶ月(第1094回)
7月19日	1年
7月20日	6ヶ月
7月22日	3ヶ月

国債入札予定

7月12日	5年
7月14日	20年
7月26日	40年
7月28日	2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6日	-
1年超3年以下	4750	4,750	6 13 19 25	7月6日	3
3年超5年以下	4750	4,750	6 19 25 29	7月6日	3
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	7月6日	1
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