



短期市場の推移

	7月6日	7月7日	7月8日	7月11日
加重平均金利	▲0.012	▲0.010	▲0.008	▲0.010
東京レポレート(TN)	▲0.170	▲0.153	▲0.129	▲0.163
無コール残	136,262	131,087	135,988	135,653
ON	67,164	60,889	66,390	65,255
その他	69,098	70,198	69,598	70,398
有コール残	30,555	29,597	29,973	27,359

7月13日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 (米)6月消費者物価コア指数[前年比]	5.7%
-	-	-	-
-	-	-	-

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。

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

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	▲0.119
T/N	-	-	▲0.010	▲0.159
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.015	▲0.008	▲0.012	▲0.162
2W	-	-	▲0.003	▲0.159
3W	-	-	-	▲0.157
1M	-	-	-	▲0.160
2M	-	-	-	-
3M	0.000	0.025	0.015	▲0.151
6M	-	-	-	▲0.141
1Y	-	-	-	▲0.135

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.006%の合出から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.004%の水準で取引された。資金調達ニーズの高まりから取り上がる動きが見られ、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
▲0.010 ~ ▲0.007	▲0.008 ~ ▲0.005	▲0.008 ~ ▲0.004

翌営業日のマーケット

引き続き資金ニーズは底堅く、出合水準は本日対比横ばいを想定する。

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

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	7月12日	7月13日	7月13日	7月14日	7月14日
券		+100		+0	▲1,000
財政		▲12,600		▲45,100	+4,000
過不足		▲12,500		▲45,100	+3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入				+1,000	
CP等買入			▲300	+4,000	
社債等買入	▲200				
国債補充供給	+14,500	▲10,700	+10,700		
当座預金増減		▲8,900		▲29,700	+3,000
当座預金残高		5,470,400		5,440,700	5,443,700
準備預金残高		4,777,900		4,777,900	4,777,900
積み終了先		4,777,900		4,777,900	4,777,900
超過準備		4,777,900		4,777,900	4,777,900
非準備先残高		692,500		692,500	692,500
準備預金進捗率		100.0%		100.0%	100.0%
平均		90.0%		90.0%	90.0%
乖離率		10.0%		10.0%	10.0%

7月12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(7/13~)	1,000	6,741	1,000	0.000	0.000	39.2
国債買入(固定利回り方式)(7/13~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(7/14~7/21)						
0	0	1,840	1,840			
国債補充供給(7/12~7/13)						
10,659	10,659	▲0.450	▲0.450			
0	0					

マネタリーベース (億円)
7月11日時点 6,729,500

所要 (億円)
今積期の所要準備額 3,746,400
7月13日以降の残り所要
積数 0
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(第1095回)
7月20日	6ヶ月
7月22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	7月6日	7月6日	-
1年超3年以下	4750	4,750	6月13日	7月6日	3
3年超5年以下	4750	4,750	6月19日	7月6日	3
5年超10年以下	5000	5,000	13月19日	6月29日	4
10年超25年以下	1250	1,250	6月25日	7月6日	1
25年超	500	500	13月29日	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

国債入札予定

7月14日	20年
7月26日	40年
7月28日	2年
8月2日	10年

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