



短期市場の推移

	7月22日	7月25日	7月26日	7月27日
加重平均金利	▲0.009	▲0.010	▲0.010	▲0.010
東京レボレート(TN)	▲0.155	▲0.123	▲0.112	▲0.118
無コール残	148,724	155,796	158,051	159,401
ON	76,811	81,228	83,103	83,318
その他	71,913	74,568	74,948	76,083
有コール残	30,944	29,298	29,363	29,248

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	▲0.040	0.001	▲0.010	▲0.140
T/N	▲0.050	▲0.008	▲0.013	▲0.204
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.170
2W	-	-	-	▲0.163
3W	-	-	-	▲0.159
1M	▲0.018	0.000	▲0.011	▲0.158
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.150
6M	-	-	-	▲0.150
1Y	-	-	-	▲0.144

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29日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:30	6月失業率 +2.5%	18:00	(欧)7月消費者物価コア指数 [前年比] -
8:50	6月鉱工業生産指数[前月比] +4.0%	21:30	(米)6月個人所得 0.5%

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▲0.008%の割合から始まり、その後は主に▲0.012%~▲0.007%の水準で取引された。昨日に引き続きビットサイドの調達意欲が堅調ななか、ON物加重平均金利(速報)も前日対比横ばいの▲0.010%であった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.012 ~ ▲0.010	- ~ -	▲0.012 ~ ▲0.007

翌営業日のマーケット

週末三日積みでビットサイドの調達意欲が強まることも想定され、出合水準は本日対比上昇と予想する。

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29日	8月1日	7月28日	7月29日
券	▲1,300	▲100	▲100	+1,000		
財政	+1,500	+10,400	+10,400	▲10,500		
過不足	+200	+10,300	+10,300	▲9,500		
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	▲200		▲2,900	+4,000		
社債等買入			▲600			
国債補完供給	+9,000	▲11,200	+11,200			
新型コロナ対応金融支援特別			▲123,500	+6,000		
当座預金増減		▲2,200	▲95,500	▲9,500		
当座預金残高		5,512,500	5,417,000	5,407,500		
準備預金残高		4,828,700			主な需給要因	
積み終了先		4,828,000			国債発行・償還(2年)	
超過準備		4,828,000			国庫短期証券発行・償還(3M)	
非準備先残高		683,800				
準備預金進捗率		99.9%				
平均乖離率		41.9%				
		58.0%				

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)(7/29~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(7/28~7/29)						
	11,016	11,016	▲0.350	▲0.351		
	20	20	▲0.350	▲0.350		
新型コロナ対応金融支援特別(7/29~1/27)						
	5,973	5,973				

マネタリーベース (億円)
7月27日時点 6,765,900

所要	所要
今積期の所要準備額	3,870,200
7月29日以降の残り所要	
積数	2,200
平均	100

国庫短期証券入札予定

7月29日	3ヶ月(第1098回)
8月5日	3ヶ月
8月9日	6ヶ月
8月12日	3ヶ月
8月2日	10年
8月4日	物価連動
8月9日	30年
8月16日	5年

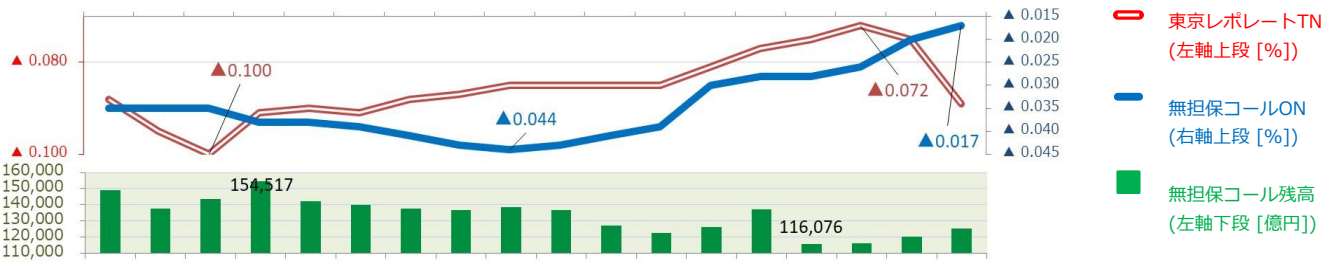
今月の国債買入オペ予定

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6日	0
1年超3年以下	4750	4,750	6 13 19 25	7月25日	0
3年超5年以下	4750	4,750	6 19 25 29	7月25日	1
5年超10年以下	5000	5,000	13 19 25 29	7月25日	1
10年超25年以下	1250	1,250	6 25	7月25日	0
25年超	500	500	13 29	7月13日	1
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	7月13日	-

1年前の市場推移

○2021年7月積み期 [7月16日~8月13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