



短期市場の推移

	7月16日	7月17日	7月18日	7月19日
加重平均金利	0.077	0.078	0.077	0.077
東京レポレート(TN)	0.052	0.041	▲0.033	0.070
無コール残	78,974	80,798	83,459	81,119
ON	34,562	36,076	38,837	35,617
その他	44,412	44,722	44,622	45,502
有コール残	39,573	39,297	39,014	39,017

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	0.070	0.125	0.083	0.092
T/N	-	-	-	0.081
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.078	0.055
2W	0.160	0.180	0.170	0.056
3W	-	-	-	0.056
1M	-	-	-	0.058
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.088
6M	-	-	-	0.143
1Y	-	-	-	0.200

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23日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
14:00	基調的なインフレ率を捕捉するための指標(6月)		-	
	-		-	
	-		-	

本日の市況

無担保コールON物は0.078%の出合から始まり、その後は主に0.075%~0.078%を中心に取引された。ビットサイドの資金調達意欲が引き続き底堅かったことに加え、一部金融機関による試し取りも行われたため、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比0.006%上昇の0.083%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	- ~ -	- ~ -	0.075 ~ 0.078

翌営業日のマーケット

引き続きビットサイドの資金調達ニーズは旺盛であるが、試し取り要因剥落のため出合の水準は本日対比低下を予想する。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	7月22日	7月23日	7月24日
券	+500	+700	+0
財政	+13,000	▲6,200	+6,000
過不足	+13,500	▲5,500	+6,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)			▲8,000
CP等買入	▲200		
社債等買入	▲200		
国債補充供給	+21,400	▲23,600	+23,600
当座預金増減	+10,900	+18,100	▲2,000
当座預金残高	5,452,900	5,471,000	5,469,000
準備預金残高	4,871,700		
積み終了先	4,870,000		
超過準備	4,869,100		
非準備先残高	581,200		
準備預金進捗率	99.8%		
平均	22.6%		
乖離率	77.2%		

7月22日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(7/22~7/23)	24,279	24,279	▲0.150	▲0.150	0	0

マネタリーベース [億円]
7月19日時点 6,688,600

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,082,100
7月23日以降の残り所要	
積数	9,300
平均	400

国庫短期証券入札予定

7月26日	3ヶ月(第1246回)
8月2日	3ヶ月
8月8日	6ヶ月
8月9日	3ヶ月

国債入札予定

7月24日	40年
7月26日	2年
8月6日	10年
8月8日	30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3日	0
1年超3年以下	3,000~4,500	3,750	3 10 17 23	7月17日	1
3年超5年以下	3,500~5,000	4,250	3 10 23 29	7月10日	2
5年超10年以下	4,000~5,500	4,250	10 17 23 29	7月17日	2
10年超25年以下	1,000~2,000	1,500	3 17 29	7月17日	1
25年超	500~1,000	750	10 29	7月10日	1
物価連動債	600	600	月1回	6月28日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

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