



短期市場の推移

[億円] [%]

	6月26日	6月27日	6月30日	7月1日
加重平均金利	0.478	0.477	0.477	0.477
東京レボレート(TN)	0.485	0.483	0.488	0.491
無コール残	82,430	79,380	78,127	78,621
ON	30,266	28,326	31,143	28,767
その他	52,164	51,054	46,984	49,854
有コール残	30,327	30,108	27,898	30,838

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。無担保コール残高は無担保コール残高の重。

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	0.450	0.478	0.477	0.492
T/N	-	-	-	0.487
S/N	-	-	-	-
1W	0.482	0.550	0.499	0.479
2W	-	-	0.478	0.480
3W	-	-	-	0.479
1M	-	-	0.600	0.480
2M	-	-	-	-
3M	0.600	0.700	0.677	0.487
6M	-	-	-	0.500
1Y	-	-	-	0.570

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

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	7月2日		7月3日		7月4日
券	▲400		▲600		+0
財政	▲58,500		+1,200		▲6,000
過不足	▲58,900		+600		▲6,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入				+8,800	スタート
国債補完供給	+4,100	▲2,200	+2,200		
当座預金増減	▲57,000		+11,600		▲6,000
当座預金残高	5,211,000		5,222,600		5,216,600
準備預金残高	4,753,700		主な需給要因		
積み終了先	4,753,200		国債発行(30年)		
超過準備	4,753,200				
非準備先残高	457,300				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	56.7%				
乖離率	43.2%				

国庫短期証券入札予定

7月4日	3ヶ月(第1316回)
7月9日	6ヶ月(第1317回)
7月11日	3ヶ月
7月17日	1年
国債入札予定	
7月3日	30年
7月8日	5年
7月10日	20年
7月15日	5年クワイメート・トランジション

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	1000	1,000	2		7月2日 0
1年超3年以下	3250	3,250	2 11 18		7月2日 2
3年超5年以下	3250	3,250	2 11 18		7月2日 2
5年超10年以下	3500	3,000	11 18 28		6月25日 3
10年超25年以下	1350	1,350	2 18 28		7月2日 2
25年超	750	750	11 28		6月25日 2
物価連動債	500	500	28		6月25日 1
変動利付債	-	300	-		4月14日 -

7月3日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
10:30	高田日銀審議委員のあいさつ(三重県)			(米) 5月の貿易収支	
	-			(米) 6月の雇用統計	
	-			-	

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.477%となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477

翌営業日のマーケット

出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

7月2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(7/3~)						
~1年	1,000	4,176	1,000	0.015	0.019	83.6
1~3年	3,250	8,452	3,251	0.007	0.010	19.2
3~5年	3,250	6,437	3,254	▲0.001	0.002	74.0
10~25年	1,350	4,862	1,350	0.010	0.010	
国債補完供給(7/2~7/3)						
	2,270	2,270	0.250	0.250		
	45	45	0.250	0.250		

マネタリーベース [億円]

7月1日時点 6,487,800

所要

今積期の所要準備額		3,995,400
7月3日以降の残り所要		
積数		3,500
平均		300

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