



短期市場の推移

[億円] [%]

	7月1日	7月2日	7月3日	7月4日
加重平均金利	0.477	0.477	0.477	0.477
東京レボ レート(TN)	0.491	0.487	0.490	0.494
無コール残	78,621	80,639	80,542	82,375
ON	28,767	30,721	29,344	31,267
その他	49,854	49,918	51,198	51,108
有コール残	30,838	29,336	29,625	29,807

7月8日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-			-	
	-			-	
	-			-	

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

[%]

本日の市況

	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	0.486
T/N	-	-	-	0.491
S/N	-	-	-	-
1W	0.480	0.610	0.535	0.481
2W	-	-	0.478	0.480
3W	-	-	-	0.481
1M	-	-	0.560	0.481
2M	-	-	-	-
3M	0.580	0.700	0.649	0.486
6M	-	-	-	0.500
1Y	-	-	-	0.571

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。

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

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月7日		7月8日		7月9日	
券	+500		+700		+0	
財政	+4,100		+8,600		▲26,000	
過不足	+4,600		+9,300		▲26,000	
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
共通担保(全店)					▲8,000	
CP等買入			▲100			
社債等買入			▲300			
国債補完供給	+2,100	▲3,000	+3,000			
当座預金増減	+3,700		+11,900		▲34,000	
当座預金残高	5,223,100		5,235,000		5,201,000	
準備預金残高	4,750,700		主な需給要因			
積み終了先	4,750,300		国債発行（5年）			
超過準備	4,750,300					
非準備先残高	472,400					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	73.3%					
乖離率	26.6%					

7月7日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(7/7~7/8)						
	3,172	3,172	0.250	0.250		
	55	55	0.250	0.250		

マネタリーベース [億円]

7月4日時点 6,439,500

所要

[億円]

今積期の所要準備額	3,982,800
7月8日以降の残り所要	
積数	1,400
平均	200

国庫短期証券入札予定

7月9日	6ヶ月(第1317回)
7月11日	3ヶ月(第1318回)
7月17日	1年
7月18日	3ヶ月

国債入札予定

7月8日	5年
7月10日	20年
7月15日	5年クライメート・トランジション
7月23日	40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	1000	1,000	2	11	18			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	-

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