



短期市場の推移

[億円] [%]

	7月7日	7月8日	7月9日	7月10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	0.492	0.489	0.491
無コール残	79,704	83,057	81,957	84,565
ON	28,376	30,079	29,139	31,137
その他	51,328	52,978	52,818	53,428
有コール残	29,811	29,425	30,765	30,852

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	0.440	0.478	0.477	0.492
T/N	-	-	-	0.492
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.481
2W	-	-	0.481	0.481
3W	-	-	0.473	0.481
1M	0.535	0.600	0.568	0.481
2M	-	-	0.565	-
3M	-	-	-	0.486
6M	-	-	-	0.500
1Y	-	-	-	0.571

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11日	7月14日	7月14日	7月15日	7月15日	7月15日
券		+400		+800		+1,000
財政		▲20,400		▲13,600		▲2,000
過不足		▲20,000		▲12,800		▲1,000
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
国債買入				+10,600		
社債等買入	▲100		▲300			
国債補完供給	+1,700	▲1,600	+1,600			
当座預金増減		▲20,000		▲900		▲1,000
当座預金残高		5,190,600		5,189,700		5,188,700
準備預金残高		4,717,700				
積み終了先		4,717,700				
超過準備		4,717,700				
非準備先残高		472,900				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		93.3%				
乖離率		6.7%				

7月11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(7/14~)

1~3年	3,250	8,196	3,253	0.007	0.009	93.8
3~5年	3,250	5,791	3,252	▲0.003	▲0.001	98.3
5~10年	3,500	7,569	3,505	▲0.003	0.000	21.8
25年~	750	1,294	750	▲0.047	▲0.023	

国債補完供給(7/11~7/14)

1,778	1,778	0.250	0.250
0	0		

マネタリーベース [億円]

7月10日時点 6,429,000

所要

[億円]

今積期の所要準備額 3,982,800

7月14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11日	3ヶ月(第1318回)
7月17日	1年(第1319回)
7月18日	3ヶ月
7月25日	3ヶ月

国債入札予定

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
7月29日	2年
8月5日	10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	7月2日	0
1年超3年以下	3250	3,250	2 11 18	7月11日	1
3年超5年以下	3250	3,250	2 11 18	7月11日	1
5年超10年以下	3500	3,500	11 18 28	7月11日	2
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	7月11日	1
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