



短期市場の推移

[億円] [%]

	7月14日	7月15日	7月16日	7月17日
加重平均金利	0.479	0.476	0.477	0.477
東京レボ レート(TN)	0.493	0.489	0.486	0.483
無コール残	84,368	85,195	82,562	83,547
ON	32,476	32,533	31,130	30,355
その他	51,892	52,662	51,432	53,192
有コール残	29,880	29,859	30,225	30,495

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	0.482
T/N	-	-	-	0.490
S/N	-	-	-	-
1W	0.481	0.610	0.535	0.481
2W	-	-	-	0.481
3W	-	-	-	0.481
1M	-	-	-	0.481
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.700	0.488
6M	-	-	-	0.502
1Y	-	-	-	0.576

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18日	7月22日	7月22日	7月23日	7月23日	7月23日
券		▲300		▲300		+0
財政		▲300		+12,600		▲3,000
過不足		▲600		+12,300		▲3,000
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				+11,200		
共通担保(全店)					▲8,000	
CP等買入			▲100			
社債等買入	▲500					
国債補充供給	+1,600	▲1,200	+1,200			
気候変動対応	▲72,400	+101,600				
当座預金増減		+28,500	+24,600		▲11,000	
当座預金残高		5,216,500	5,241,100		5,230,100	
準備預金残高		4,732,800				主な需給要因
積み終了先		4,728,100	国庫短期証券発行償還			
超過準備		4,709,800	(3M・1Y)			
非準備先残高		483,700				
準備預金進捗率		99.5%				
平均		19.4%				
乖離率		80.1%				

国庫短期証券入札予定

7月25日	3ヶ月(第1321回)
8月1日	3ヶ月
8月7日	6ヶ月
8月8日	3ヶ月

国債入札予定

7月23日	40年
7月29日	2年
8月5日	10年
8月7日	30年

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオペ金額	直近オペ額	オペ予定日	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18日	0
3年超5年以下	3250	3,250	2 11 18	7月18日	0
5年超10年以下	3500	3,500	11 18 28	7月18日	1
10年超25年以下	1350	1,350	2 18 28	7月18日	1
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	-

7月22日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-		(米)パウエルFRB議長の 挨拶		
	-		-		
	-		-		

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18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(7/22~)						
1~3年	3,250	6,268	3,255	▲0.005	▲0.003	49.9
3~5年	3,250	5,720	3,252	▲0.017	▲0.012	69.4
5~10年	3,500	5,555	3,500	▲0.026	▲0.016	
10~25年	1,350	2,307	1,351	▲0.039	▲0.027	88.8
国債補充供給(7/18~7/22)						
	1,402	1,402	0.250	0.250		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

7月17日時点 6,405,400

所要

今積期の所要準備額		4,121,200
7月22日以降の残り所要		
積数	21,800	
平均	900	

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