



短期市場の推移

[億円] [%]

	7月16日	7月17日	7月18日	7月22日
加重平均金利	0.477	0.477	0.477	0.479
東京レボ レート(TN)	0.486	0.483	0.490	0.490
無コール残	82,562	83,547	82,634	86,354
ON	31,130	30,355	29,952	33,952
その他	51,432	53,192	52,682	52,402
有コール残	30,225	30,495	30,398	31,539

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	0.450	0.525	0.478	0.486
T/N	-	-	-	0.488
S/N	-	-	-	-
1W	0.480	0.485	0.483	0.482
2W	0.478	0.530	0.481	0.482
3W	-	-	0.560	0.481
1M	-	-	-	0.481
2M	-	-	-	-
3M	0.570	0.700	0.606	0.487
6M	-	-	-	0.505
1Y	-	-	-	0.582

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

7月24日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-		(米) 7月の製造業PMIと サービス業PMI (速報)	
-		(欧) 7月の製造業PMIと サービス業PMI (速報)	
-		(欧) ECB理事会	

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▲0.001%の0.478%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\$

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月23日	7月24日	7月23日	7月24日	7月23日	7月24日
券	▲200	▲300			▲200	▲300
財政	▲800	▲1,200			▲800	▲1,200
過不足	▲1,000	▲1,500			▲1,000	▲1,500
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	+8,000			▲8,000	+8,000
CP等買入	▲200				▲200	
国債補完供給	+2,500	▲1,800	+1,800		+2,500	▲1,800
当座預金増減	▲500	+300			▲500	+300
当座預金残高	5,237,100	5,237,400			5,237,100	5,237,400
準備預金残高	4,766,300				4,766,300	
積み終了先	4,764,200				4,764,200	
超過準備	4,762,800				4,762,800	
非準備先残高	470,800				470,800	
準備預金進捗率	99.7%				99.7%	
平均	25.8%				25.8%	
乖離率	73.9%				73.9%	

7月23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(7/23~7/24)

2,058	2,058	0.250	0.250
0	0		

マナタリーベース [億円]

7月22日時点 6,455,600

所要

[億円]

今積期の所要準備額	4,121,200
7月24日以降の残り所要	
積数	13,700
平均	600

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29日	2年
8月5日	10年
8月7日	30年
8月13日	5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	-

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