上田八木短資

デイリーシグナル

2025年7月24日(木)

短期市場の推移 [億円] [%]

	7月17日	7月18日	7月22日	7月23日
加重平均金利	0.477	0.477	0.479	0.478
東京レポレート(TN)	0.483	0.490	0.490	0.488
無コール残	83,547	82,634	86,354	83,676
ON	30,355	29,952	33,952	33,104
その他	53,192	52,682	52,402	50,572
有コール残	30,495	30,398	31,539	31,905

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポ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。

7月25日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	東京都区部CPI（7月）			-	
	-			-	
	-			-	

本日の短期市場金利 [%]

	無担保コール(速報)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	0.450	0.525	0.477	0.487
T/N	-	-	-	0.485
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.478	0.481
2W	-	-	-	0.481
3W	-	-	-	0.481
1M	-	-	-	0.481
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.490
6M	-	-	-	0.511
1Y	-	-	-	0.595

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

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0.477%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$

資金需給 [億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月24日		7月25日		7月28日	
券	▲300		▲300		+0	
財政	▲3,800		+9,500		▲5,000	
過不足	▲4,100		+9,200		▲5,000	
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
CP等買入			▲300			
社債等買入			▲300			
国債補完供給	+1,800	▲1,700	+1,700			
当座預金増減	▲4,000		+10,300		▲5,000	
当座預金残高	5,233,100		5,243,400		5,238,400	
準備預金残高	4,768,900		主な需給要因			
積み終了先	4,767,200				国庫短期証券発行償還	
超過準備	4,767,000				(3M)	
非準預先残高	464,200				流動性供給	
準備預金進捗率	99.7%					
平均	29.0%					
乖離率	70.7%					

7月24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(7/24～7/25)						
		1,836	1,836	0.250	0.250	
		0	0			

マネタリーベース [億円]

7月23日時点	6,455,200

所要 [億円]

今積期の所要準備額	4,121,200
7月25日以降の残り所要	
積数	11,800
平均	500

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 [億円]

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