



短期市場の推移

	6月26日	6月29日	6月30日	7月1日
加重平均金利	0.977	0.978	0.976	0.977
東京レボレート(TN)	1.000	0.998	1.000	1.000
無コール残	94,243	94,979	86,997	99,063
ON	34,097	35,333	31,666	38,537
その他	60,146	59,646	55,331	60,526
有コール残	24,316	24,005	23,196	25,432

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、無担保コール残高は無担保コール残高の値  
 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	0.950	1.030	0.977	0.998
T/N	-	-	-	1.000
S/N	-	-	-	-
1W	1.030	1.050	1.041	1.000
2W	-	-	-	1.000
3W	-	-	-	1.000
1M	1.030	1.060	1.042	1.001
2M	-	-	-	-
3M	-	-	1.220	1.008
6M	-	-	-	1.056
1Y	-	-	-	1.160

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3日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	日銀当座預金増減要因 (7月見込み)		(欧) ユーロ圏サービス業 PMI (6月)		
14:00	需給ギャップ・潜在成長利率及び労働需給関連指標		-		
	-		-		

本日の市況

無担保コールON物は0.977%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)は前営業対比横ばいの0.977%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.977 ~ 0.977	0.977 ~ 0.977

翌営業日のマーケット

出合い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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月2日	7月3日	7月3日	7月6日	7月6日	7月6日
券		▲400		+200		+0
財政		▲34,600		▲23,100		+8,000
過不足		▲35,000		▲22,900		+8,000
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
国債補完供給	+900	▲400	+400			
当座預金増減		▲34,500		▲22,500		+8,000
当座預金残高		4,348,600		4,326,100		4,334,100
準備預金残高		4,021,000		4,021,000		4,021,000
積み終了先		4,021,000		4,021,000		4,021,000
超過準備		4,021,000		4,021,000		4,021,000
非準備先残高		327,600		327,600		327,600
準備預金進捗率		99.9%		99.9%		99.9%
平均		56.7%		56.7%		56.7%
乖離率		43.2%		43.2%		43.2%

7月2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(7/2~7/3)	431	431	0.750	0.750		
	0	0				

マネタリーベース [億円]  
7月1日時点 5,579,600

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,080,800
7月3日以降の残り所要	
積数	400
平均	0

国庫短期証券入札予定

7月3日	3ヶ月(第1391回)
7月8日	6ヶ月(第1392回)
7月10日	3ヶ月
7月16日	1年
7月7日	30年
7月9日	5年
7月14日	20年
7月22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	1,000	1,000	6				6月3日	1
1年超3年以下	3,550	2,550	15	23			6月26日	2
3年超5年以下	3,200	2,300	15	29			6月18日	2
5年超10年以下	3,350	2,400	6	23			6月26日	2
10年超25年以下	1,000	800	6	23			6月18日	2
25年超	750	750	15	29			6月26日	2
物価連動債	300	400	29				6月26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