



短期市場の推移

	7月6日	7月7日	7月8日	7月9日
加重平均金利	0.977	0.978	0.978	0.978
東京レボレート(TN)	1.000	1.000	1.000	1.000
無コール残	95,757	97,169	98,178	100,283
ON	35,076	35,318	34,490	36,715
その他	60,681	61,851	63,688	63,568
有コール残	24,549	24,745	25,380	25,775

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	0.950	0.979	0.977	1.000
T/N	-	-	-	1.000
S/N	-	-	-	-
1W	1.040	1.055	1.044	1.000
2W	0.981	1.050	0.996	1.000
3W	-	-	1.110	1.000
1M	1.040	1.120	1.073	1.001
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	1.008
6M	-	-	-	1.057
1Y	-	-	-	1.163

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13日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) ポウマンFRB副議長の講演	-
-	-	(米) ウォラーFRB理事の講演	-
-	-	-	-

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▲0.001%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10日	7月13日	7月13日	7月14日	7月14日
券		+300	+300	+500	
財政		▲18,300	▲20,300	▲7,000	
過不足		▲18,000	▲20,000	▲6,500	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	スタート
国債補完供給	+1,500	▲1,100	+1,100		
社債等買入	▲500		▲200		
当座預金増減		▲18,100	▲19,100	▲6,500	
当座預金残高		4,347,600	4,328,500	4,322,000	
準備預金残高		4,015,100	主な需給要因		
積み終了先		4,015,100	国庫短期証券発行償還	源泉所得税揚げ	
超過準備		4,015,100	(3M)		
非準備先残高		332,500			
準備預金進捗率		100.0%			
平均		90.0%			
乖離率		10.0%			

7月10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(7/10~7/13)	1,195	1,195	0.750	0.750		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
7月9日時点 5,561,600

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,062,000
7月13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16日	1年 (第1394回)
7月17日	3ヶ月(第1395回)
7月24日	3ヶ月
7月30日	3ヶ月
国債入札予定	
7月14日	20年
7月22日	40年
7月30日	2年
8月4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	1,000	1,000	6	23			7月6日	0
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	3,350	6	23			7月6日	1
10年超25年以下	1,000	1,000	6	23			7月6日	1
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