



短期市場の推移

[億円] [%]

	7月7日	7月8日	7月9日	7月10日
加重平均金利	0.978	0.978	0.978	0.977
東京レポレート(TN)	1.000	1.000	1.000	1.000
無コール残	97,169	98,178	100,283	97,378
ON	35,318	34,490	36,715	33,530
その他	61,851	63,688	63,568	63,848
有コール残	24,745	25,380	25,775	24,874

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重。

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	0.950	1.030	0.977	1.000
T/N	-	-	-	1.000
S/N	-	-	-	-
1W	0.983	1.060	1.025	1.000
2W	-	-	1.150	1.000
3W	-	-	1.060	1.000
1M	1.080	1.100	1.090	1.001
2M	-	-	-	-
3M	-	-	1.220	1.008
6M	-	-	-	1.057
1Y	-	-	-	1.163

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

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	7月13日	7月14日	7月15日
券	+400	+300	+0
財政	▲19,900	▲13,200	▲10,000
過不足	▲19,500	▲12,900	▲10,000
金融調節	エンド	エンド	エンド
社債等買入	▲200	スタート	スタート
国債補完供給	+1,100	▲900	+900
当座預金増減	▲19,500	▲12,000	▲10,000
当座預金残高	4,328,100	4,316,100	4,306,100
準備預金残高	3,998,500	主な需給要因	
積み終了先	3,998,500	源泉所得税揚げ	国債発行(20年)
超過準備	3,998,500		国債発行償還(個人)
非準備先残高	329,600		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	93.3%		
乖離率	6.7%		

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		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 -

7月14日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
13:30	鉱工業生産(5月)		(米) CPI(6月)		
	-		-		
	-		-		

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\$

7月13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(7/13~7/14)	899	835	0.750	0.398		
	100	100	0.750	0.750		

マネタリーベース [億円]

7月10日時点 5,543,100

所要

今積期の所要準備額		4,062,000
7月14日以降の残り所要		
積数	0	
平均	0	

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