



短期市場の推移

[億円] [%]

	7月9日	7月10日	7月13日	7月14日
加重平均金利	0.978	0.977	0.977	0.977
東京レボレート(TN)	1.000	1.000	1.000	1.000
無コール残	100,283	97,378	98,133	100,281
ON	36,715	33,530	33,805	34,828
その他	63,568	63,848	64,328	65,453
有コール残	25,775	24,874	24,577	23,857

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重。

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	0.981	1.000
T/N	-	-	-	1.000
S/N	-	-	-	-
1W	0.981	0.985	0.983	1.000
2W	-	-	1.065	1.000
3W	-	-	-	1.000
1M	1.050	1.100	1.066	1.000
2M	-	-	1.090	-
3M	-	-	-	1.009
6M	-	-	-	1.058
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

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	7月15日	7月16日	7月17日
券	▲100	▲500	▲500
財政	▲9,000	+3,100	▲7,000
過不足	▲9,100	+2,600	▲7,500
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+7,200
社債等買入	▲100		
国債補完供給	+300	▲400	+500
当座預金増減	▲9,300	+10,300	▲7,500
当座預金残高	4,306,700	4,317,000	4,309,500
準備預金残高	3,981,800	主な需給要因	
積み終了先	3,981,800	流動性供給	
超過準備	3,981,800		
非準備先残高	324,900		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	100.0%		
乖離率	0.0%		

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22日	40年
7月30日	2年
8月4日	10年
8月6日	30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	3,550	15 23	7月15日	1
3年超5年以下	3,200	3,200	15 29	7月15日	1
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	7月15日	1
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16日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-		(米) 小売売上高 (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。一部金融機関による試し取りが行われたことから、ON物加重平均金利(速報)は前営業対比+0.004%の0.981%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

試し取り要因が剥落することから、出合いの中心は0.977%程度と予想する。

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

7月15日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(7/16~)						
1~3年	3,550	8,287	3,554	0.002	0.004	39.4
3~5年	3,200	6,806	3,204	▲0.022	▲0.020	87.9
25年~	750	1,903	751	0.025	0.029	68.9
国債補完供給(7/15~7/16)						
	324	324	0.750	0.750		
	50	50	0.750	0.750		

マネタリーベース [億円]

7月14日時点 5,510,900

所要

来積期の所要準備額	4,195,400
7月16日以降の残り所要	
積数	4,195,400
平均	135,300

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