



短期市場の推移

[億円] [%]

	7月14日	7月15日	7月16日	7月17日
加重平均金利	0.977	0.981	0.979	0.977
東京レボ レート(TN)	1.000	1.000	1.000	1.000
無コール残	100,281	101,688	101,720	100,893
ON	34,828	36,045	36,917	35,639
その他	65,453	65,643	64,803	65,254
有コール残	23,857	24,032	23,771	24,219

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	0.977	1.000
T/N	-	-	-	1.000
S/N	-	-	-	-
1W	0.983	1.110	1.030	1.000
2W	-	-	1.050	1.000
3W	-	-	-	1.000
1M	-	-	1.100	1.000
2M	-	-	-	-
3M	1.200	1.250	1.234	1.009
6M	-	-	-	1.059
1Y	-	-	-	1.168

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21日	7月22日	7月23日
券	▲600	+300	▲500
財政	+12,300	+2,100	▲3,000
過不足	+11,700	+2,400	▲3,500
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債補完供給	+1,100	+700	スタート
社債等買入	▲100		エンド
気候変動対応	▲101,600	+139,800	スタート
共通担保(全店)		▲8,000	+8,000
当座預金増減	+50,200	+3,100	▲3,500
当座預金残高	4,366,800	4,369,900	4,366,400
準備預金残高	4,032,900	主な需給要因	
積み終了先	4,015,200	国債発行(40年)	
超過準備	4,015,000		
非準備先残高	333,900		
準備預金進捗率	99.2%		
平均	19.4%		
乖離率	79.8%		

国庫短期証券入札予定

7月24日	3ヶ月(第1396回)
7月30日	3ヶ月
8月6日	6ヶ月
8月7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	一回当たりオペファー金額	直近オペファー額	オペファー予定日	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22日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	貿易収支(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21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(7/21~7/22)	862	862	0.500	0.498		
共通担保(全店)(7/22~8/5)	8,000	22,663	8,003		35.3	
米ドル資金供給(7/23~7/30)	2	2	3.87	3.87		

マネタリーベース [億円]

7月17日時点 5,512,400

所要

今積期の所要準備額		4,195,400
7月22日以降の残り所要		
積数	35,300	
平均	1,400	

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