



短期市場の推移

[億円] [%]

	7月17日	7月21日	7月22日	7月23日
加重平均金利	0.977	0.977	0.978	0.980
東京レボレート(TN)	1.000	1.000	1.000	1.000
無コール残	100,893	102,832	104,817	102,036
ON	35,639	36,278	37,113	35,342
その他	65,254	66,554	67,704	66,694
有コール残	24,219	24,517	24,332	24,040

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	1.025	0.977	0.999
T/N	-	-	-	1.000
S/N	-	-	-	-
1W	0.981	1.030	1.006	1.000
2W	-	-	-	1.000
3W	-	-	-	1.000
1M	-	-	1.105	1.000
2M	-	-	-	-
3M	-	-	1.230	1.016
6M	-	-	-	1.078
1Y	-	-	-	1.203

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24日	7月27日	7月27日	7月28日	7月28日	7月28日
券		▲100	+100	+500		
財政		+7,800	+10,000	+1,000		
過不足		+7,700	+10,100	+1,500		
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
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+200					
国債買入		+7,500				
当座預金増減		+15,400	+10,000	+1,500		
当座預金残高		4,393,700	4,403,700	4,405,200		
準備預金残高		4,059,900				
積み終了先		4,058,800				
超過準備		4,057,900				
非準備先残高		333,800				
準備預金進捗率		99.8%				
平均		35.5%				
乖離率		64.4%				

国庫短期証券入札予定

7月30日	3ヶ月(第1397回)
8月6日	6ヶ月
8月7日	3ヶ月
8月14日	3ヶ月

国債入札予定

7月30日	2年
8月4日	10年
8月6日	30年
8月12日	物価連動

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23日	0
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23日	0
10年超25年以下	1,000	1,000	6 23	7月23日	0
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27日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-			-	
	-			-	
	-			-	

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。試し取り要因剥落により、ON物加重平均金利(速報)は前営業対比▲0.003%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24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(7/24~7/27)	55	55	0.500	0.500		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

7月23日時点 5,574,400

所要

今積期の所要準備額		4,195,400
7月27日以降の残り所要		
積数	6,800	
平均	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