



短期市場の推移

[億円] [%]

	7月22日	7月23日	7月24日	7月27日
加重平均金利	0.978	0.980	0.977	0.978
東京レポレート(TN)	1.000	1.000	1.000	1.000
無コール残	104,817	102,036	99,310	103,678
ON	37,113	35,342	33,196	36,614
その他	67,704	66,694	66,114	67,064
有コール残	24,332	24,040	23,552	24,054

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	0.980	0.998
T/N	-	-	-	0.999
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.985	1.000
2W	-	-	1.060	1.000
3W	-	-	-	1.000
1M	1.100	1.180	1.127	1.000
2M	-	-	1.170	-
3M	-	-	-	1.022
6M	-	-	-	1.082
1Y	-	-	-	1.215

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28日	7月29日	7月30日
券	+500	▲300	+500
財政	▲2,700	▲9,500	+1,000
過不足	▲2,200	▲9,800	+1,500
金融調節	エンド	エンド	エンド
社債等買入	▲300	▲100	+100
国債補完供給	▲100	+100	
当座預金増減	▲2,600	▲9,700	+1,500
当座預金残高	4,401,800	4,392,100	4,393,600
準備預金残高	4,056,000	流動性供給	
積み終了先	4,054,500		
超過準備	4,054,500		
非準備先残高	345,800		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	41.9%		
乖離率	58.0%		

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	-

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

7月29日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-		(米)FOMC (2日目)	
-		-	
-		-	

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+0.002%の0.980%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28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(7/28~7/29)	89	89	0.500	0.500		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

7月27日時点 5,600,500

所要

今積期の所要準備額	4,195,400
7月29日以降の残り所要	
積数	4,000
平均	200