



短期市場の推移

[億円] [%]

	7月23日	7月24日	7月27日	7月28日
加重平均金利	0.980	0.977	0.978	0.980
東京レボ レート(TN)	1.000	1.000	1.000	0.999
無コール残	102,036	99,310	103,678	102,705
ON	35,342	33,196	36,614	36,791
その他	66,694	66,114	67,064	65,914
有コール残	24,040	23,552	24,054	23,544

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	0.998
T/N	-	-	-	0.998
S/N	-	-	-	-
1W	0.984	1.060	0.990	1.000
2W	-	-	-	1.000
3W	-	-	-	1.000
1M	-	-	1.100	1.001
2M	-	-	-	-
3M	1.230	1.250	1.244	1.025
6M	-	-	-	1.084
1Y	-	-	-	1.217

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29日	7月30日	7月30日	7月31日	7月31日
券		▲200		▲100	▲100
財政		▲10,300		+1,600	▲1,600
過不足		▲10,500		+1,500	▲1,700
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入				+4,100	スタート
国債補充供給	+100	▲300	+300		
当座預金増減		▲10,700		+5,900	▲1,700
当座預金残高		4,391,100		4,397,000	4,395,300
準備預金残高		4,054,400	主な需給要因		
積み終了先		4,052,900			
超過準備		4,052,900			
非準備先残高		336,700			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		45.2%			
乖離率		54.7%			

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29日	0
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29日	0
物価連動債	300	300	29						7月29日	0
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(登録)第243号 加入協会 日本証券業協会

7月30日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
日銀金融政策決定会合 (1日目)			(米)GDP (4~6月/1次速報値)		
-			(欧)ユーロ圏GDP (4~6月/1次速報値)		
-			-		

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。試し取り要因が剥落したことから、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29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(7/30~)						
3~5年	3,200	9,718	3,205	▲0.018	▲0.018	57.0
25年~	750	1,366	751	▲0.007	0.002	81.3
物価連動	300	1,124	300	▲0.260	▲0.376	59.7
国債補充供給(7/29~7/30)						
	449	449	0.500	0.500		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

7月28日時点 5,597,400

所要

[億円]

今積期の所要準備額	4,195,400
7月30日以降の残り所要	
積数	2,500
平均	100