



短期市場の推移

	6月26日	6月27日	6月28日	7月1日
加重平均金利	0.077	0.077	0.076	0.077
東京レポレート(TN)	0.052	▲0.061	0.047	0.061
無コール残	79,744	79,177	79,425	77,488
ON	33,545	33,908	39,831	36,517
その他	46,199	45,269	39,594	40,971
有コール残	37,680	37,508	36,121	38,060

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意。
 本日の短期市場金利 [%]

7月3日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) ADP雇用統計 (6月)	-
-	-	(米) 貿易収支 (5月)	-
-	-	(米) FOMC議事録 (6月11~12日開催分)	-

無担保コール(速報)

	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	0.065	0.078	0.077	0.078
T/N	-	-	-	0.079
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.125	0.054
2W	-	-	0.165	0.051
3W	-	-	-	0.051
1M	-	-	0.150	0.051
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.084
6M	-	-	-	0.139
1Y	-	-	-	0.200

本日の市況

無担保コールON物は0.078%の出合から始まり、その後は主に0.075%~0.078%を中心に取引された。ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.077%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	0.075 ~ 0.078

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの資金調達ニーズは底堅く、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月2日	7月3日	7月3日	7月4日	7月4日	7月4日
券	+1,100	▲15,400	▲15,400	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲6,200	▲57,500	▲57,500	+1,000	+1,000	+1,000
過不足	▲5,100	▲72,900	▲72,900	+0	+0	+0
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
国債補完供給	+26,500	▲31,000	+31,000			
当座預金増減	▲9,600	▲41,900	▲41,900	+0	+0	+0
当座預金残高	5,510,000	5,468,100	5,468,100	5,468,100		
準備預金残高	4,915,500	主な需給要因				
積み終了先	4,915,400	法人税・消費税・保				
超過準備	4,915,400	険揚げ				
非準備先残高	594,500	国債発行(10年)				
準備預金進捗率	99.9%					
平均	56.7%					
乖離率	43.2%					

7月2日のオペ結果

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

米ドル資金供給(7/5~7/11)	0	0	5.580	5.580
国債補完供給(7/2~7/3)	31,765	31,765	▲0.150	▲0.150
	17	17	▲0.150	▲0.150

国庫短期証券入札予定

7月5日	3ヶ月(第1241回)
7月9日	6ヶ月(第1242回)
7月12日	3ヶ月
7月18日	1年

今月の国債買入オペ予定

オベ種類	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
			月1回	月1回	月1回	月1回		
1年以下	1500	1,500	7	12	18	24	6月7日	1
1年超3年以下	3,000~4,500	3,750	7	12	18	24	6月24日	4
3年超5年以下	3,500~5,000	4,250	12	18	24	28	6月28日	4
5年超10年以下	4,000~5,500	4,250	7	12	18	24	6月24日	4
10年超25年以下	1,000~2,000	1,500	7	18	28		6月28日	3
25年超	500~1,000	750	12	28			6月28日	2
物価連動債	600	600	月1回				6月28日	1
変動利付債	-	300	-				4月14日	-

国債入札予定

7月4日	30年
7月9日	5年
7月11日	20年
7月18日	5年(クワイメント・トランジション)

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