



短期市場の推移

	7月1日	7月2日	7月3日	7月4日
加重平均金利	0.077	0.077	0.077	0.077
東京レボレート(TN)	0.061	0.079	0.051	0.044
無コール残	77,488	77,348	79,854	80,567
ON	36,517	33,977	36,733	38,156
その他	40,971	43,371	43,121	42,411
有コール残	38,060	38,235	39,114	39,941

[億円] [%]

7月8日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	経常収支 (5月)			
8:50	貿易収支 (5月)			
	-		-	

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 [%]

	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	0.050	0.078	0.077	0.051
T/N	-	-	-	0.067
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.052
2W	-	-	-	0.051
3W	-	-	-	0.052
1M	0.180	0.230	0.205	0.051
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.220	0.086
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。ビット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

引き続きビット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、東京レボ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5日	7月8日	7月8日	7月9日	7月9日	7月9日
券	▲1,600	+300	+300	+1,000	+1,000	+1,000
財政	+5,100	+5,600	+5,600	+2,000	+2,000	+2,000
過不足	+3,500	+5,900	+5,900	+3,000	+3,000	+3,000
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
CP等買入	▲300		▲300			
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+24,000	▲22,500	+22,500			
当座預金増減	+4,700	+28,000	+28,000	+3,000	+3,000	+3,000
当座預金残高	5,455,300	5,483,300	5,483,300	5,486,300	5,486,300	5,486,300
準備預金残高	4,845,100			主な需給要因		
積み終了先	4,845,000	国庫短期証券発行償還				
超過準備	4,845,000	(3M)				
非準備先残高	610,200					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	73.3%					
乖離率	26.6%					

7月5日のオペ結果

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(7/5~7/8)	23,084	23,084	▲0.250	▲0.250	0	0

マネタリーベース [億円]
7月4日時点 6,704,200

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,944,900
7月8日以降の残り所要	
積数	200
平均	0

国庫短期証券入札予定

7月9日	6ヶ月(第1242回)
7月12日	3ヶ月(第1243回)
7月18日	1年
7月19日	3ヶ月
7月9日	5年
7月11日	20年
7月18日	5年クライメート・トランジション
7月24日	40年

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	1500	1,500	月1回	7月3日	0
1年超3年以下	3,000~4,500	3,750	3 10 17 23	7月3日	3
3年超5年以下	3,500~5,000	4,250	3 10 23 29	7月3日	3
5年超10年以下	4,000~5,500	4,250	10 17 23 29	6月24日	4
10年超25年以下	1,000~2,000	1,500	3 17 29	7月3日	2
25年超	500~1,000	750	10 29	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	-

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