



短期市場の推移

	7月2日	7月3日	7月4日	7月5日
加重平均金利	0.077	0.077	0.077	0.077
東京レポレート(TN)	0.079	0.051	0.044	0.067
無コール残	77,348	79,854	80,567	81,633
ON	33,977	36,733	38,156	39,139
その他	43,371	43,121	42,411	42,494
有コール残	38,235	39,114	39,941	39,921

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 [%]

	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	0.060	0.078	0.077	0.087
T/N	-	-	-	0.058
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.051
2W	-	-	0.190	0.051
3W	-	-	-	0.051
1M	-	-	-	0.051
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.210	0.087
6M	-	-	-	0.140
1Y	-	-	-	0.200

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

7月9日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
債券市場参加者会合 (7月10日まで)			
-		-	
-		-	

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底堅く、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旺盛であり、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月8日	7月9日	7月9日	7月10日	7月10日	7月10日
券	+400		+600		+0	
財政	+3,100		+1,100		▲21,000	
過不足	+3,500		+1,700		▲21,000	
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
共通担保(全店)					▲8,000	
CP等買入	▲300					
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+22,500	▲22,400	+22,400			
当座預金増減	+3,200		+24,100		▲29,000	
当座預金残高	5,458,500		5,482,600		5,453,600	
準備預金残高	4,849,500					
積み終了先	4,849,400					
超過準備	4,849,400					
非準備先残高	609,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	76.7%					
乖離率	23.2%					

7月8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(7/8~7/9)	23,003	23,003	▲0.150	▲0.150		
	0	0				

マネタリーベース	[億円]
7月5日時点	6,710,500

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,944,900
7月9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

国債入札予定

7月9日	5年
7月11日	20年
7月18日	5年クライマート・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