



短期市場の推移

	7月4日	7月5日	7月8日	7月9日
加重平均金利	0.077	0.077	0.077	0.077
東京レボレート(TN)	0.044	0.067	0.058	0.069
無コール残	80,567	81,633	79,734	79,797
ON	38,156	39,139	37,600	37,363
その他	42,411	42,494	42,134	42,434
有コール残	39,941	39,921	41,012	41,044

7月11日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) 6月の消費者物価	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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	0.055	0.150	0.077	0.083
T/N	-	-	-	0.076
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.075	0.055
2W	-	-	0.210	0.054
3W	0.150	0.170	0.157	0.056
1M	-	-	0.165	0.056
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.089
6M	-	-	-	0.142
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

引き続きビット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。

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10日	7月11日	7月11日	7月12日	7月12日
券	+1,100	+900	+900	+0	+0
財政	▲18,400	▲9,400	▲9,400	▲8,000	▲8,000
過不足	▲17,300	▲8,500	▲8,500	▲8,000	▲8,000
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			+12,900		
共通担保(全店)	▲8,000	+8,000			
CP等買入	▲700		▲300		
社債等買入	▲300		▲100		
国債補充供給	+22,300	▲21,800	+21,800		
当座預金増減	▲17,800	+25,800	+25,800	▲8,000	▲8,000
当座預金残高	5,443,800	5,469,600	5,469,600	5,461,600	5,461,600
準備預金残高	4,834,000				
積み終了先	4,833,900				
超過準備	4,833,900				
非準備先残高	609,800				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	83.3%				
乖離率	16.6%				

7月10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
------	------	----	----	----	----	----

国債買入(7/11~)						
1~3年	3,750	9,504	3,752	▲0.018	▲0.011	5.9
3~5年	4,250	8,096	4,252	▲0.013	▲0.006	29.7
5~10年	4,250	9,267	4,257	0.010	0.012	84.2
25年~	750	2,120	753	0.025	0.030	49.5

国債補充供給(7/10~7/11)						
	22,413	22,413	▲0.150	▲0.150		
1	1	1	▲0.150	▲0.150		

マナタリーベース	【億円】	所要
7月9日時点	6,715,700	

所要		【億円】
今積期の所要準備額	7月11日以降の残り所要	3,944,900
積数	平均	100
		0

国庫短期証券入札予定

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26日	3ヶ月
7月11日	20年
7月18日	5年クワイメート・トランジション
7月24日	40年
7月26日	2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10日	2
3年超5年以下	3,500~5,000	4,250	3 10 23 29	7月10日	2
5年超10年以下	4,000~5,500	4,250	10 17 23 29	7月10日	3
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	7月10日	1
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