



短期市場の推移

	7月5日	7月8日	7月9日	7月10日
加重平均金利	0.077	0.077	0.077	0.077
東京レポレート(TN)	0.067	0.058	0.069	0.076
無コール残	81,633	79,734	79,797	72,696
ON	39,139	37,600	37,363	30,872
その他	42,494	42,134	42,434	41,824
有コール残	39,921	41,012	41,044	41,142

7月12日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
13:30	鉱工業生産 (5月)		(米) 6月の生産者物価指数		
	-		-		
	-		-		

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	0.070	0.079	0.077	0.079
T/N	-	-	-	0.053
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.240	0.053
2W	0.140	0.170	0.152	0.053
3W	-	-	-	0.054
1M	-	-	-	0.055
2M	-	-	-	-
3M	0.230	0.240	0.237	0.088
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11日	7月12日	7月12日	7月16日	7月16日	7月16日
券		+800	+800		+2,000	
財政		▲10,200	▲20,000		+2,000	
過不足		▲9,400	▲19,200		+4,000	
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
国債買入		+12,900				
CP等買入	▲300					
社債等買入	▲100		▲100			
国債補充供給	+21,800	▲21,000	+21,000			
当座預金増減		+3,900	+1,700		+4,000	
当座預金残高		5,447,700	5,449,400		5,453,400	
準備預金残高		4,847,400				
積み終了先		4,847,300				
超過準備		4,847,300				
非準備先残高		600,300				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		86.7%				
乖離率		13.2%				

7月11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
CP等買入(7/17~)	3,000	8,404	2,994	0.191	0.200	26.9
国債補充供給(7/11~7/12)	21,481	21,481	▲0.150	▲0.150		
	41	41	▲0.150	▲0.150		

マネタリーベース [億円]
7月10日時点 6,696,700

所要		所要
今積期の所要準備額	3,944,900	
7月12日以降の残り所要		
積数	100	
平均	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(第1244回)
7月19日	3ヶ月
7月26日	3ヶ月
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
7月26日	2年
8月6日	10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