



短期市場の推移

	7月10日	7月11日	7月12日	7月16日
加重平均金利	0.077	0.077	0.077	0.077
東京レボレート(TN)	0.076	0.053	0.080	0.052
無コール残	72,696	75,402	75,197	78,974
ON	30,872	33,458	31,520	34,562
その他	41,824	41,944	43,677	44,412
有コール残	41,142	40,281	39,757	39,573

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	0.070	0.079	0.078	0.079
T/N	-	-	-	0.041
S/N	-	-	-	-
1W	0.075	0.175	0.082	0.051
2W	-	-	0.180	0.053
3W	-	-	-	0.055
1M	-	-	-	0.056
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.089
6M	-	-	-	0.142
1Y	-	-	-	0.200

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

7月18日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	貿易収支 (6月)			(欧) ECB理事会	
	-			-	
	-			-	

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0.001%上昇の0.078%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。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	7月17日	7月18日	7月17日	7月18日	7月19日
券		+1,500		+700	+0
財政		▲23,500		+9,000	▲3,000
過不足		▲22,000		+9,700	▲3,000
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				+9,600	
CP等買入	▲100	+3,000	▲100		
国債補完供給	+22,700	▲25,600	+25,600		
気候変動対応					▲34,400
当座預金増減		▲22,000		+44,800	▲37,400
当座預金残高		5,375,600		5,420,400	5,383,000
準備預金残高		4,785,300	主な需給要因		
積み終了先		4,712,900	国債発行 (GX5年)		
超過準備		4,298,800			
非準備先残高		590,300			
準備預金進捗率		98.0%			
平均		6.5%			
乖離率		91.5%			

7月17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(7/18~)						
1~3年	3,750	12,722	3,755	▲0.009	▲0.008	90.1
5~10年	4,250	7,590	4,257	▲0.015	▲0.012	56.8
10~25年	1,500	2,075	1,501	▲0.014	▲0.008	86.3
国債補完供給(7/17~7/18)						
26,309	26,309	▲0.150	▲0.150			
0	0					

マネタリーベース (億円)
7月16日時点 6,647,700

所要	(億円)
今積期の所要準備額	4,082,100
7月18日以降の残り所要	
積数	82,500
平均	2,800

国庫短期証券入札予定

7月18日	1年 (第1244回)
7月19日	3ヶ月 (第1245回)
7月26日	3ヶ月
8月2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17日	1
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17日	2
10年超25年以下	1,000~2,000	1,500	3 17 29	7月17日	1
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