



短期市場の推移

	7月22日	7月23日	7月24日	7月25日
加重平均金利	0.083	0.080	0.080	0.081
東京レボレート(TN)	0.081	0.062	0.045	0.033
無コール残	81,230	80,933	77,806	78,049
ON	35,738	34,891	32,634	32,827
その他	45,492	46,042	45,172	45,222
有コール残	39,023	37,978	37,963	37,144

[億円] [%]

7月29日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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	0.070	0.078	0.078	0.079
T/N	-	-	-	0.078
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.230	0.067
2W	-	-	0.180	0.070
3W	-	-	-	0.071
1M	-	-	-	0.080
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.210	0.108
6M	-	-	-	0.153
1Y	-	-	-	0.209

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。本日は試し取りの影響が無くなった為、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比0.003%低下の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。

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26日	7月29日	7月29日	7月30日	7月30日	7月30日
券		▲100	+200			+1,000
財政		+9,900	+6,300			+4,000
過不足		+9,800	+6,500			+5,000
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	▲600		▲500			
社債等買入	▲100		▲100			
国債補完供給	+20,100	▲18,400	+18,400			
当座預金増減		+10,800	+24,300			+5,000
当座預金残高		5,479,900	5,504,200			5,509,200
準備預金残高		4,884,600				主な需給要因
積み終了先		4,883,800	国庫短期証券発行償還			
超過準備		4,883,700	(3M)			
非準備先残高		595,300				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		41.9%				
乖離率		58.0%				

7月26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(7/31~)	3,000	7,368	2,990	0.226	0.246	
国債補完供給(7/26~7/29)	18,965	18,965	▲0.250	▲0.250		
	50	50	▲0.250	▲0.250		

マネタリーベース [億円]
7月25日時点 6,715,000

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,082,100
7月29日以降の残り所要	
積数	2,200
平均	100

国庫短期証券入札予定

8月2日	3ヶ月(第1247回)
8月8日	6ヶ月
8月9日	3ヶ月
8月16日	3ヶ月
8月6日	10年
8月8日	30年
8月14日	5年
8月16日	物価連動

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23日	0
3年超5年以下	3,500~5,000	4,250	3 10 23 29	7月23日	1
5年超10年以下	4,000~5,500	4,250	10 17 23 29	7月23日	1
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