



短期市場の推移

	7月23日	7月24日	7月25日	7月26日
加重平均金利	0.080	0.080	0.081	0.078
東京レポレート(TN)	0.062	0.045	0.033	0.078
無コール残	80,933	77,806	78,049	74,593
ON	34,891	32,634	32,827	29,381
その他	46,042	45,172	45,222	45,212
有コール残	37,978	37,963	37,144	35,822

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	0.078	0.077	0.081
T/N	-	-	-	0.074
S/N	-	-	-	-
1W	0.078	0.250	0.081	0.074
2W	-	-	-	0.077
3W	-	-	-	0.079
1M	-	-	-	0.090
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.115
6M	-	-	-	0.155
1Y	-	-	-	0.211

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30日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀金融政策決定会合 (1日目)		(欧) 4~6月のGDP	
8:30 有効求人倍率 (6月)		-	
-		-	

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%低下の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。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月29日	7月30日	7月30日	7月31日	7月31日	7月31日
券		+200	▲400	+500		+500
財政		+2,900	+4,900	+6,000		+6,000
過不足		+3,100	+4,500	+6,500		+6,500
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			▲11,500			
CP等買入	▲500		▲100			+3,000
社債等買入	▲100					
国債補充供給	+18,400	▲20,500	+20,500			
当座預金増減		+400	+36,400	+9,500		
当座預金残高		5,480,300	5,516,700	5,526,200		
準備預金残高		4,901,700				主な需給要因
積み終了先		4,900,900				
超過準備		4,900,900				
非準備先残高		578,600				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		45.2%				
乖離率		54.7%				

7月29日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(7/30~)						
3~5年	4,250	9,453	4,255	▲0.022	▲0.019	39.3
5~10年	4,250	8,010	4,255	▲0.024	▲0.022	30.0
10~25年	1,500	3,279	1,502	▲0.022	▲0.019	10.9
25年~	750	2,268	752	▲0.018	▲0.017	73.0
物価連動	600	1,997	600	0.440	0.219	23.4
国債補充供給(7/29~7/30)						
	21,135	21,135	▲0.150	▲0.150		
	0	0				

マナタリーベース 【億円】
7月26日時点 6,725,900

所要	【億円】
今積期の所要準備額	4,082,100
7月30日以降の残り所要	
積数	1,400
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29日	0
5年超10年以下	4,000~5,500	4,250	10 17 23 29	7月29日	0
10年超25年以下	1,000~2,000	1,500	3 17 29	7月29日	0
25年超	500~1,000	750	10 29	7月29日	0
物価連動債	600	600	月1回	7月29日	0
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