

短期市場の推移

	7月1日	7月2日	7月3日	7月6日
加重平均金利	▲0.041	▲0.039	▲0.034	▲0.034
東京レポレート(ON)	▲0.071	▲0.090	▲0.083	▲0.066
無コール残	94,145	107,297	101,459	100,996
ON	64,117	73,194	66,206	63,303
その他	30,028	34,103	35,253	37,693
有コール残	17,654	18,309	18,048	18,162

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。

7月8日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	5月国際収支(経常収支)	10882億円	-	-
	-	-	-	-
	-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

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	0.001	▲0.027	▲0.074
T/N	-	-	-	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	▲0.040	▲0.043	▲0.083
2W	-	-	▲0.010	▲0.084
3W	-	-	-	▲0.086
1M	-	-	0.000	▲0.094
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.108
6M	-	-	-	▲0.161
1Y	-	-	-	▲0.186

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

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.030%の出合から始まり、その後は主に▲0.045%~▲0.025%の水準で出合が見られた。引き続き大手行を中心に調達ニーズが強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.007%の▲0.027%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.025	▲0.025 ~ ▲0.010	▲0.045 ~ ▲0.023

翌営業日のマーケット

大手行の出合が中心となり、引き続き堅調な地合が継続すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月7日	7月8日	7月8日	7月9日	7月9日	7月9日
券	+500	+200	+200	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	+7,500	▲5,400	▲5,400	+2,000	+2,000	+2,000
過不足	+8,000	▲5,200	▲5,200	+1,000	+1,000	+1,000
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
国庫短期証券買入				+25,000		
国債買入		+4,200				
CP等買入	▲200		▲100			
社債等買入					+3,000	
ETF買入				+1,700		
国債補完供給		▲200	+200			
米ドル資金供給用担保国債供給				▲3,700		
当座預金増減	+11,800	+17,900	+17,900	+4,000	+4,000	+4,000
当座預金残高	4,441,400	4,459,300	4,459,300	4,463,300	4,463,300	4,463,300
準備預金残高	3,832,600	主な需給要因				
積み終了先	3,832,500					
超過準備	3,832,500					
非準備先残高	608,800					
準備預金進捗率	99.9%	国債発行(30年)				
平均	73.3%					
乖離率	26.6%					

7月7日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接点
国庫短期証券買入(7/8~)	25,000	70,759	25,002	0.010	0.014	75.0
米ドル資金供給(7/9~7/16)		19,607	19,607	0.330	0.330	
米ドル資金供給(7/9~10/1)		7,910	7,910	0.320	0.320	
国債補完供給(7/7~7/8)		162	162	▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給用担保国債供給(7/8~7/17)		5,000	2,080	▲0.100	▲0.100	
米ドル資金供給用担保国債供給(7/8~10/2)		5,000	1,559	▲0.100	▲0.100	

マナタリーベース [億円]
7月6日時点 5,614,600

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,357,200
7月8日以降の残り所要積数 600
平均 100

国庫短期証券入札予定

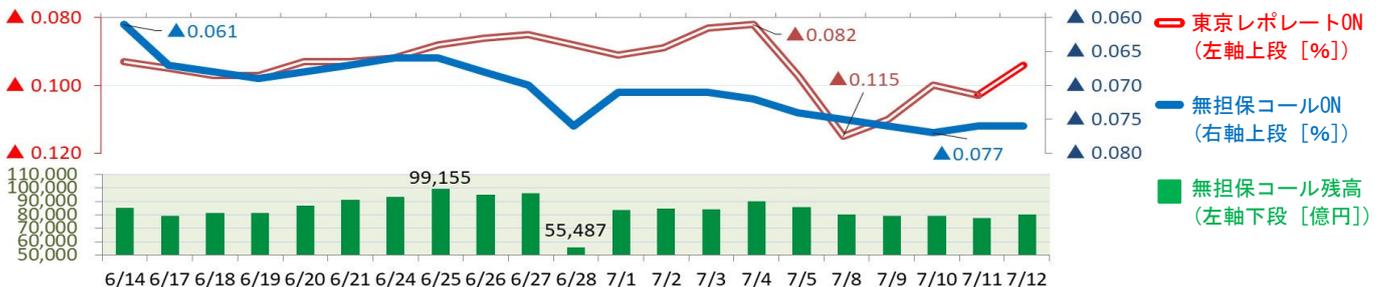
7月9日	6ヶ月	第920回
7月10日	3ヶ月	第921回
7月16日	1年	
7月17日	3ヶ月	
7月9日	5年	
7月21日	20年	
7月28日	40年	
7月30日	2年	

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	500~1,500	1,000	月3回程度	7月1日	2
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	3 8 10 17 22 29	7月3日	5
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	1 3 8 17 22 29	7月3日	4
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	6 10 17 22 31	7月6日	4
10年超25年以下	500~2,000	1,200	3 27	7月3日	1
25年超	0~500	300	10 31	6月17日	2
物価連動債	300	300	月2回程度	6月12日	2
変動利付債<偶数月>	1,000	1,000	-	6月3日	-

1年前の市場推移 ○2019年6月積み期 [6月14日~7月12日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



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。投資については最終決定は、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(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会