

### 短期市場の推移

	7月6日	7月7日	7月8日	7月9日
加重平均金利	▲0.034	▲0.027	▲0.023	▲0.021
東京レポレート(ON)	▲0.066	▲0.074	▲0.084	▲0.083
無コール残	100,996	99,575	99,657	108,965
ON	66,206	63,303	62,119	71,942
その他	34,790	36,272	37,538	37,023
有コール残	18,162	17,057	17,171	16,500

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13日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		(英)中銀総裁 講演	

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	▲0.055	0.001	▲0.017	▲0.082
T/N	-	-	-	▲0.072
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.078
2W	-	-	-	▲0.082
3W	-	-	-	▲0.087
1M	-	-	0.000	▲0.093
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.104
6M	-	-	-	▲0.157
1Y	-	-	-	▲0.178

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▲0.020%の出合から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.015%の水準で出合が見られた。3日積みということもあり、国内の幅広い業態による調達ニーズが強かったため、地合は昨日対比で強含み、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.004%の▲0.017%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.025 ~ ▲0.015

### 翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達ニーズは強く、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10日	7月13日	7月13日	7月14日	7月14日	7月14日
券		+100	+500	+0		
財政		▲31,900	▲19,000	▲23,000		
過不足		▲31,800	▲18,500	▲23,000		
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			+8,800			
共通担保(全店)			▲1,900	+1,900		
CP等買入	▲400		▲300			
ETF買入		+400				
米ドル資金供給用担保国債供給	+21,500		▲5,600	+23,300		
新型コロナ対応金融支援特別						
当座預金増減		▲10,300	+7,700	▲23,000		
当座預金残高		4,463,500	4,471,200	4,448,200		
準備預金残高		3,859,000				
積み終了先		3,859,000				
超過準備		3,858,900				
非準備先残高		604,500				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		90.0%				
乖離率		9.9%				
			国庫短期証券 発行・償還(3M)			
			源泉税揚げ			

### 7月10日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(7/13~)						
1~3年	4,200	13,331	4,210	▲0.002	▲0.001	14.4
5~10年	4,200	8,721	4,204	▲0.001	0.000	75.9
25年~	300	1,043	305	0.007	0.008	16.5
米ドル資金供給(7/14~7/21)						
			108	108	0.330	0.330
国債補完供給(7/10~7/13)						
			21	21	▲0.350	▲0.350
			0	0		
共通担保(全店)(7/13~7/27)						
	20,000	1,890	1,890			
新型コロナ対応金融支援特別(7/13~1/27)						
	23,333	23,333				

マナタリーベース	所要
7月9日時点 5,658,400	今積期の所要準備額 3,357,200
	7月13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16日	1年	第922回
7月17日	3ヶ月	第923回
7月21日	6ヶ月	
7月22日	3ヶ月	
国債入札予定		
7月21日	20年	
7月28日	40年	
7月30日	2年	
8月4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	500~1,500	1,000	月3回程度	7月8日	1
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	3 8 10 17 22 29	7月10日	3
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	1 3 8 17 22 29	7月8日	3
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	6 10 17 22 31	7月10日	3
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	7月10日	1
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。