



短期市場の推移

	6月28日	6月29日	6月30日	7月1日
加重平均金利	▲0.030	▲0.029	▲0.050	▲0.030
東京レボレート(TN)	▲0.083	▲0.095	▲0.082	▲0.081
無コール残	122,785	129,690	94,974	114,452
ON	61,779	70,094	66,688	67,906
その他	61,006	59,596	28,286	46,546
有コール残	22,491	20,672	18,664	18,983

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	0.001	▲0.027	▲0.077
T/N	▲0.015	▲0.001	▲0.003	▲0.075
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.030	0.000	▲0.019	▲0.080
2W	▲0.040	▲0.020	▲0.033	▲0.084
3W	-	-	0.010	▲0.089
1M	▲0.030	▲0.020	▲0.023	▲0.093
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.100
6M	-	-	-	▲0.113
1Y	-	-	-	▲0.129

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5日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:00頃	【挨拶】黒田総裁 (支店長会議)	-	(米)休場 (独立記念日の振替休日)	-
14:00	地域経済報告(7月)	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.025%の出合から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.015%の水準で出合が見られた。週末3日積みであったため出合いの水準はやや上昇し、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.003%の▲0.027%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.035	- ~ -	▲0.050 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

週末3日積み要因が剥落するため、出合水準は本日対比でやや低下を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	7月2日	7月5日	7月5日	7月6日	7月6日
券	▲300	+700	+700	+0	+0
財政	▲59,700	▲5,900	▲5,900	+3,000	+3,000
過不足	▲60,000	▲5,200	▲5,200	+3,000	+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				+10,700	
CP等買入	▲100				
社債等買入	▲200				
E T F買入				+600	
国債補充供給	+400				
当座預金増減	▲59,900	+6,100	+6,100	+3,000	+3,000
当座預金残高	5,295,500	5,301,600	5,301,600	5,304,600	5,304,600
準備預金残高	4,661,200				
積み終了先	4,661,200				
超過準備	4,661,000				
非準備預金先高	634,300				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	63.3%				
乖離率	36.6%				

7月2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(7/5~)						
1~3年	4,500	15,455	4,506	0.003	0.004	81.0
3~5年	4,500	12,157	4,504	0.002	0.002	84.1
10~25年	1,500	3,246	1,505	0.000	0.001	73.6

国債補充供給(7/2~7/5)

2	2	▲0.350	▲0.350
0	0		

マネタリーベース (億円)
7月1日時点 6,572,500

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,632,600
7月5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8日	6ヶ月	第1006回
7月9日	3ヶ月	第1007回
7月15日	3ヶ月	
7月19日	1年	
7月6日	30年	
7月8日	5年	
7月13日	20年	
7月27日	40年	

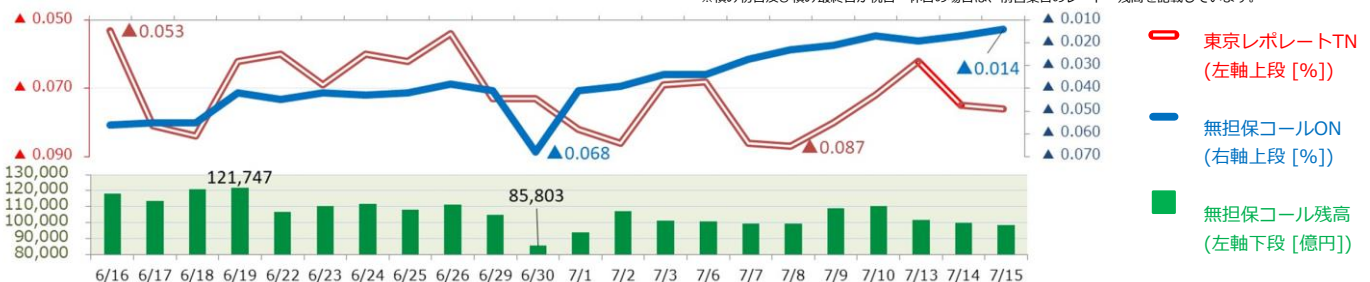
今月の国債買入オペ予定

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	6月23日	1
1年超3年以下	4500	4,500	2 7 14 21	7月2日	3
3年超5年以下	4500	4,500	2 14 21 28	7月2日	3
5年超10年以下	4250	4,500	7 14 21 28	6月28日	4
10年超25年以下	1500	1,500	2 14	7月2日	0
25年超	500	500	14	6月28日	1
物価連動債	600	600	月1回	6月9日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	4月21日	-

1年前の市場推移

○2020年6月積み期 [6月16日~7月15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。 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