



短期市場の推移

	[億円] [%]			
	6月30日	7月1日	7月2日	7月5日
加重平均金利	▲0.050	▲0.030	▲0.027	▲0.031
東京レボレート(TN)	▲0.082	▲0.081	▲0.075	▲0.072
無コール残	94,974	114,452	122,228	111,449
ON	66,688	67,906	70,317	58,208
その他	28,286	46,546	51,911	53,241
有コール残	18,664	18,983	20,957	21,460

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	▲0.032	▲0.076
T/N	-	-	▲0.001	▲0.075
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.025	▲0.017	▲0.024	▲0.079
2W	▲0.040	▲0.015	▲0.023	▲0.082
3W	-	-	-	▲0.087
1M	▲0.025	0.150	0.020	▲0.092
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.099
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7日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	日本銀行の対政府取引 (6月)	-	(米)FOMC議事録 (6/15・6/16開催分)	
8:50	マネタリーベースと日本銀行の取引 (6月)	-	-	
15:00	コール市場残高 (6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▲0.050%の合出から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.020%の水準で合出が見られた。放出サイド・調達サイドのともに大きな変化はなく、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.032%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.045	▲0.035 - ▲0.035	▲0.050 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの一部で調達意欲が減退する先も想定され、出合い水準は本日比若干の低下と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	7月6日		7月7日		7月8日
券	+0		+300		+0
財政	+12,400		▲7,900		+4,000
過不足	+12,400		▲7,600		+4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			▲15,000		
共通担保(全店)			▲3,800	+2,400	
CP等買入	▲100		▲100		
E T F買入				+100	
国債補充供給		▲100	+100		
当座預金増減	+12,200		+6,100		+4,000
当座預金残高	5,308,800		5,314,900		5,318,900
準備預金残高	4,686,500		4,686,500		4,686,500
積み終了先	4,686,500		4,686,500		4,686,500
超過準備	4,686,500		4,686,500		4,686,500
非準備先残高	622,300		622,300		622,300
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%
平均	70.0%		70.0%		70.0%
乖離率	29.9%		29.9%		29.9%

7月6日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(7/7~)	15,000	41,059	15,006	0.003	0.003	88.0
国債補充供給(7/6~7/7)	63	63	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(7/7~7/21)	20,000	2,351	2,351			

マネタリーベース [億円]
7月5日時点 6,513,500

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,632,600
7月7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8日	5年
7月13日	20年
7月27日	40年
7月29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	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