



### 短期市場の推移

	7月1日	7月2日	7月5日	7月6日
加重平均金利	▲0.030	▲0.027	▲0.031	▲0.032
東京レボレート(TN)	▲0.081	▲0.075	▲0.072	▲0.075
無コール残	114,452	122,228	111,449	112,062
ON	67,906	70,317	58,208	57,516
その他	46,546	51,911	53,241	54,546
有コール残	18,983	20,957	21,460	19,948

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	▲0.072
T/N	-	-	▲0.001	▲0.072
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.025	▲0.020	▲0.023	▲0.077
2W	-	-	▲0.008	▲0.082
3W	-	-	-	▲0.087
1M	-	-	-	▲0.091
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.099
6M	-	-	-	▲0.112
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)	18,668億円	21:30	(米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
	-			-	
	-			-	

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▲0.030%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。同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.032%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.040	▲0.035 ~ ▲0.035	▲0.050 ~ ▲0.020

### 翌営業日のマーケット

調運動向に変化はなく、出合い水準は本日対比横ばいと予想。

### 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
券	+300	▲500	▲500	▲1,000	▲1,000
財政	▲5,600	+3,900	+3,900	▲24,000	▲24,000
過不足	▲5,300	+3,400	+3,400	▲25,000	▲25,000
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			
国債買入				+9,400	
共通担保(全店)	▲3,800	+2,400			
CP等買入	▲100				
E T F買入		+100			
国債補完供給	+100				
当座預金増減	+8,400	+12,800	+12,800	▲25,000	▲25,000
当座預金残高	5,317,200	5,330,000	5,330,000	5,305,000	5,305,000
準備預金残高	4,704,900				
積み終了先	4,704,900				
超過準備	4,704,900				
非準備先残高	612,300				
準備預金進捗率	99.9%				
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	按分
国債買入(7/8~)						
1~3年	4,500	13,734	4,501	▲0.001	0.000	63.2
5~10年	4,250	13,825	4,255	▲0.012	▲0.009	49.4
変動利付	300	780	300	▲1.000	▲1.056	62.0
米ドル資金供給(7/9~7/15)						
	1	1	0.350	0.350		
社債等買入(7/12~)						
	1,250	2,296	1,251	▲0.062	▲0.053	86.7
国債補完供給(7/7~7/8)						
	11	11	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース	所要
7月6日時点	6,525,700

所要	所要
今積期の所要準備額	3,627,900
7月8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	

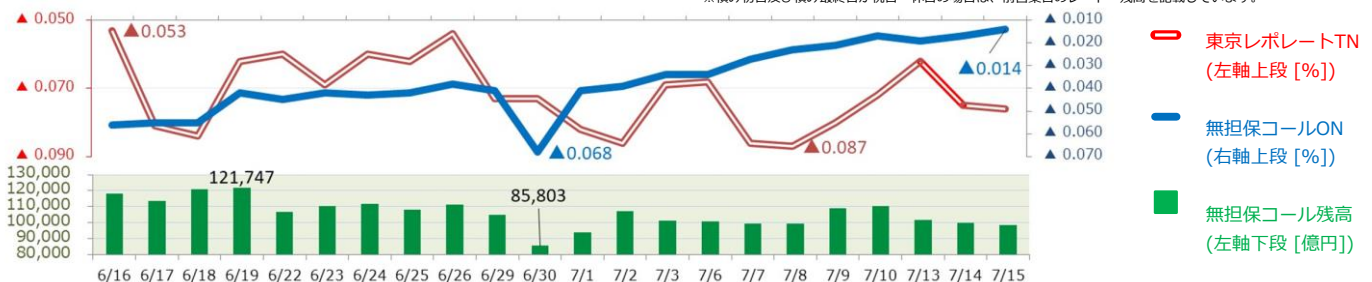
### 今月の国債買入オペ予定

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7日	2
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	4,250	7 14 21 28	7月7日	3
10年超25年以下	1500	1,500	2	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	7月7日	0

### 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