



短期市場の推移

	7月5日	7月6日	7月7日	7月8日
加重平均金利	▲0.031	▲0.032	▲0.032	▲0.033
東京レポレート(TN)	▲0.072	▲0.075	▲0.072	▲0.074
無コール残	111,449	112,062	113,134	115,285
ON	58,208	57,516	57,638	59,439
その他	53,241	54,546	55,496	55,846
有コール残	21,460	19,948	20,662	19,530

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
 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	▲0.034	▲0.072
T/N	▲0.020	▲0.001	▲0.005	▲0.075
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.020	0.000	▲0.018	▲0.079
2W	-	-	-	▲0.082
3W	-	-	▲0.001	▲0.087
1M	-	-	0.001	▲0.091
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.015	▲0.100
6M	-	-	-	▲0.116
1Y	-	-	-	▲0.129

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

7月12日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本		海外	
	内容	予想	内容	予想
8:50	6月国内企業物価指数 [前年比]	+4.8%	-	-
8:50	企業物価指数 (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

3日積みとなる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▲0.055%~▲0.020%の水準で出合が見られた。オファーサイド・ビッドサイドの動向は昨日と大きな変化はなく、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.034%となった。また、日本銀行は7月積み期間におけるマクロ加算残高の算出に用いる基準比率を18.5%に定めることとした。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.045	▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.055 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

調達動向に大きな変化はなく、出合水準は本日対比横ばい圏と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月9日	7月12日	7月12日	7月13日	7月13日	7月13日
券		+300		+500		+0
財政		▲23,200		+14,100		+3,000
過不足		▲22,900		+14,600		+3,000
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
CP等買入			▲400			
社債等買入				+1,300		
当座預金増減		▲22,900		+15,500		+3,000
当座預金残高		5,307,600		5,323,100		5,326,100
準備預金残高		4,680,900	主な需給要因			
積み終了先		4,680,900	国庫短期証券			
超過準備		4,680,900	発行・償還			
非準備先残高		626,700	(3M・6M)			
準備預金進捗率		100.0%				
平均		86.7%				
乖離率		13.3%				

7月9日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(7/9~7/12)	0	0	0	0		

マネタリーベース (億円)

7月8日時点 6,547,700

所要	所要準備額	積数	平均
今積期の所要準備額	3,627,900	0	0
7月12日以降の残り所要		0	0

国庫短期証券入札予定

7月15日	3ヶ月 第1008回
7月19日	1年
7月20日	6ヶ月
7月21日	3ヶ月

国債入札予定

7月13日	20年
7月27日	40年
7月29日	2年
8月3日	10年

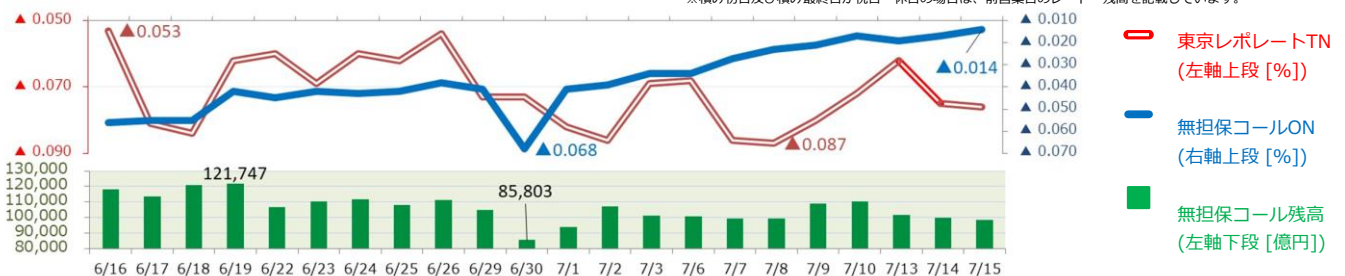
今月の国債買入オペ予定

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	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