



短期市場の推移

	7月8日	7月9日	7月12日	7月13日
加重平均金利	▲0.033	▲0.034	▲0.035	▲0.038
東京レボレート(TN)	▲0.074	▲0.075	▲0.080	▲0.086
無コール残	115,285	120,664	114,262	117,915
ON	59,439	65,068	60,386	63,579
その他	55,846	55,596	53,876	54,336
有コール残	19,530	20,184	20,547	19,225

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	▲0.043	▲0.093
T/N	-	-	▲0.001	▲0.100
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.025	▲0.009	▲0.016	▲0.090
2W	▲0.030	0.001	▲0.019	▲0.091
3W	-	-	-	▲0.093
1M	▲0.008	0.001	▲0.005	▲0.096
2M	-	-	▲0.030	-
3M	-	-	0.013	▲0.100
6M	-	-	-	▲0.114
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15日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀金融政策決定会合 (7/16まで)		(米)パウエルFRB議長の議会証言	
-		-	
-		-	

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%~▲0.025%の水準で出合が見られた。地銀業態を中心に調達ニーズの弱まりが見られ、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.005%の▲0.043%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.050 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

積み期最終日にビッドサイドの一部が調達に積極的な姿勢を見せることも想定され、出合水準は本日対比で横ばいからやや上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月14日	7月15日	7月15日	7月16日	7月16日	7月16日
券		+100	▲900	▲1,000		
財政		▲29,700	+2,300	+1,000		
過不足		▲29,600	+1,400	+0		
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
国庫短期証券買入		+12,500				
国債買入			+13,900			
CP等買入	▲200		▲500			+5,000
社債等買入	▲100		▲100			
国債補充供給	+100					
当座預金増減		▲17,300	+14,700	+5,000		
当座預金残高		5,295,400	5,310,100	5,315,100		
準備預金残高		4,656,300				
積み終了先		4,656,300				
超過準備		4,656,300				
非準備先残高		639,100				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		96.7%				
乖離率		3.3%				

7月14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(7/15~)						
1~3年	4,500	12,770	4,506	▲0.004	▲0.002	7.8
3~5年	4,500	12,133	4,503	▲0.005	▲0.004	24.0
5~10年	4,250	7,758	4,252	▲0.003	0.000	70.0
25年~	500	1,604	505	▲0.002	▲0.001	34.0

国債補充供給(7/14~7/15)						
	21	21	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース	【億円】
7月13日時点	6,528,800

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,627,900
7月15日以降の残り所要	
積数	0
平均	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	第1009回
7月20日	6ヶ月	第1010回
7月21日	3ヶ月	第1011回

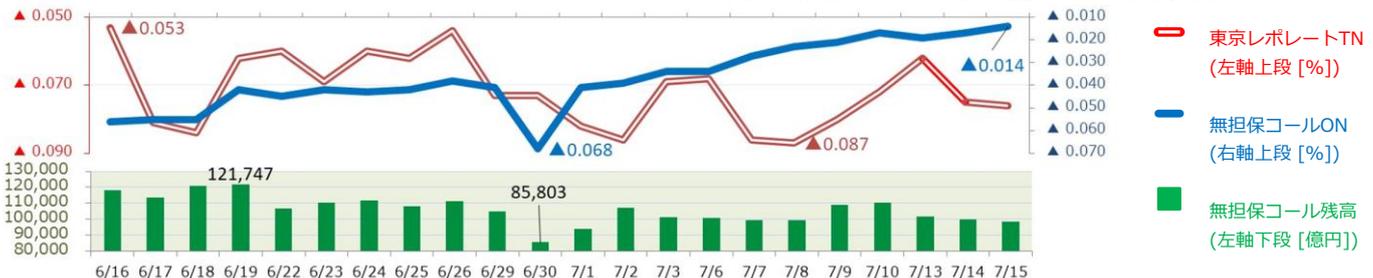
今月の国債買入オペ予定

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14日	1
3年超5年以下	4500	4,500	2 14 21 28	7月14日	2
5年超10年以下	4250	4,250	7 14 21 28	7月14日	2
10年超25年以下	1500	1,500	2 14	7月2日	0
25年超	500	500	14	7月14日	0
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	-

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