



短期市場の推移

	7月9日	7月12日	7月13日	7月14日
加重平均金利	▲0.034	▲0.035	▲0.038	▲0.043
東京レボレート(TN)	▲0.075	▲0.080	▲0.086	▲0.100
無コール残	120,664	114,262	117,915	121,737
ON	65,068	60,386	63,579	67,351
その他	55,596	53,876	54,336	54,386
有コール残	20,184	20,547	19,225	19,459

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	▲0.065	0.001	▲0.037	▲0.089
T/N	-	-	▲0.001	▲0.086
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.033	▲0.015	▲0.024	▲0.086
2W	▲0.025	▲0.003	▲0.018	▲0.089
3W	-	-	▲0.020	▲0.093
1M	▲0.010	▲0.008	▲0.008	▲0.096
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲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16日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
金融政策決定会合の決定内容	-	21:30 (米)6月小売売上高	-0.5%
経済・物価情勢の展望(7月、基本的見解)	-	23:00 (米)7月ミシガン大学消費者信頼感指数速報	86.5
17:00 業態別の日銀当座預金残高(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▲0.035%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。積み期最終調整のための調達ニーズの高まりが都銀・信託業態を中心に見られ、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.006%の▲0.037%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.035	▲0.045 ~ ▲0.020	▲0.050 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

積み期が変わるため慎重な調達姿勢となる取り手が多くなり、出合いの水準は本日対比でやや低下すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	7月15日	7月16日	7月16日	7月19日	7月19日
券	▲900	▲800	▲800	▲1,000	▲1,000
財政	▲600	+800	+800	+10,000	+10,000
過不足	▲1,500	+0	+0	+9,000	+9,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	スタート
国債買入		+13,900			
CP等買入	▲500		▲500	+5,000	
社債等買入	▲100				
国債補充供給		▲500	+500		
当座預金増減		+11,300	+5,000	+9,000	+9,000
当座預金残高		5,306,700	5,311,700	5,320,700	5,320,700
準備預金残高		4,665,100			
積み終了先		4,665,100			
超過準備		4,665,100			
非準備先残高		641,600			
準備預金進捗率		100.0%			
平均		100.0%			
乖離率		0.0%			

7月15日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(7/15~7/16)						
	138	138	▲0.350	▲0.350		
	363	363	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース (億円)
7月14日時点 6,511,500

所要	(億円)
来積期の所要準備額	3,747,800
7月16日以降の残り所要	
積数	3,747,800
平均	120,900

国庫短期証券入札予定

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
7月30日	3ヶ月	

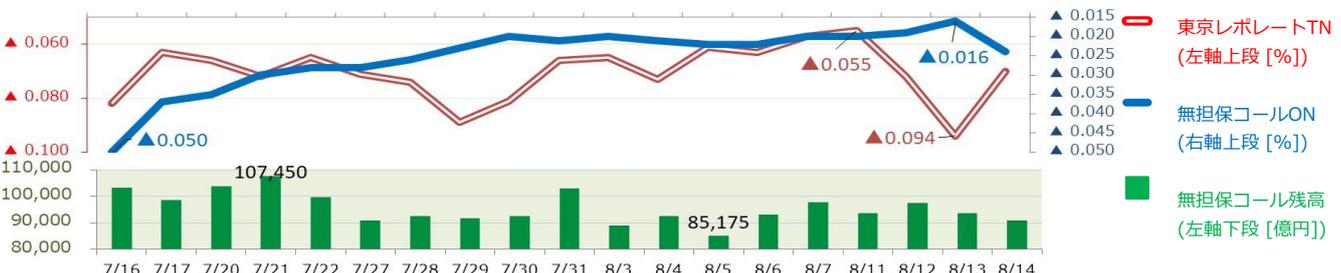
今月の国債買入オペ予定

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	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7月積み期 [7月16日~8月14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