



短期市場の推移

	7月14日	7月15日	7月16日	7月19日
加重平均金利	▲0.043	▲0.037	▲0.035	▲0.035
東京レポレート(TN)	▲0.100	▲0.086	▲0.088	▲0.095
無コール残	121,737	133,039	148,944	137,777
ON	67,351	81,453	96,263	82,066
その他	54,386	51,586	52,681	55,711
有コール残	19,459	20,546	19,815	21,155

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	▲0.035	▲0.095
T/N	▲0.020	▲0.001	▲0.008	▲0.100
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.033	▲0.015	▲0.024	▲0.097
2W	▲0.040	0.010	▲0.033	▲0.097
3W	▲0.007	0.001	▲0.003	▲0.097
1M	▲0.028	0.050	▲0.002	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.180	▲0.105
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21日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	内容	日本		海外	
		実績	予想	実績	予想
8:50	政策委員会・金融政策決定会合 議事要旨(6月17・18日分)	-	-	-	-
		-	-	-	-
		-	-	-	-

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▲0.040%の合出から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.025%の水準で合出が見られた。引き続きビッドサイドの調達意欲が強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.035%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.050 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

週末5日積みであり様々な業態が積極的に調達するため、出会いの水準は上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月20日	7月21日	7月21日	7月26日	7月26日	7月26日
券	▲2,100	▲1,300	▲1,300	+1,000	+1,000	+1,000
財政	▲8,400	+5,900	+5,900	+5,000	+5,000	+5,000
過不足	▲10,500	+4,600	+4,600	+6,000	+6,000	+6,000
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
共通担保(全店)			▲2,400	+4,000		
CP等買入	▲500		▲200			
社債等買入	▲500		▲500			+800
国債補完供給	+100	▲100	+100			
当座預金増減	▲11,500	+5,600	+5,600	+6,800	+6,800	+6,800
当座預金残高	5,305,600	5,311,200	5,311,200	5,318,000	5,318,000	5,318,000
準備預金残高	4,615,100					
積み終了先	4,614,500					
超過準備	4,613,700					
非準備先残高	690,500					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	16.1%					
乖離率	83.7%					

7月20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
国債補完供給(7/20~7/21)	91	91	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(7/21~8/4)	0	0				
	20,000	3,951	3,951			

マナリーベース (億円)
7月19日時点 6,535,900

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,747,800
7月21日以降の残り所要	
積数	4,800
平均	200

国庫短期証券入札予定

7月21日	3ヶ月 第1011回
7月30日	3ヶ月
8月5日	6ヶ月
8月6日	3ヶ月

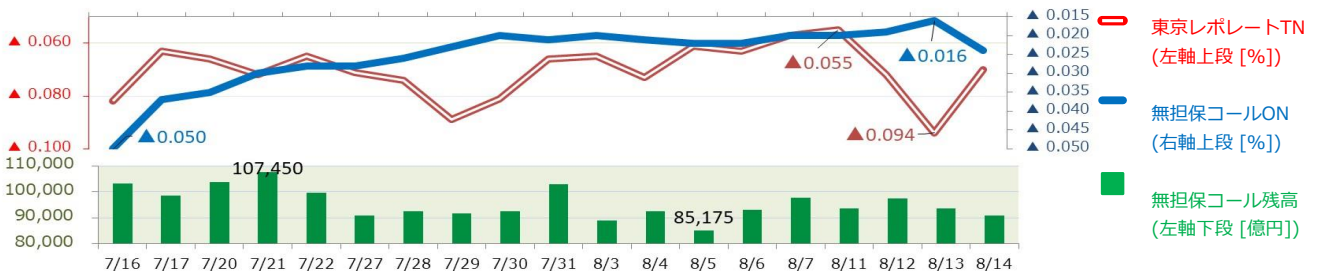
今月の国債買入オペ予定

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回程度	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回程度	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