



短期市場の推移

	7月20日	7月21日	7月26日	7月27日
加重平均金利	▲0.035	▲0.038	▲0.038	▲0.039
東京レポレート(TN)	▲0.100	▲0.091	▲0.090	▲0.091
無コール残	143,658	154,517	142,328	140,200
ON	86,362	95,121	82,472	79,924
その他	57,296	59,396	59,856	60,276
有コール残	18,389	19,737	20,641	20,094

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	▲0.041	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.088
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.040	0.015	▲0.022	▲0.091
2W	▲0.045	0.001	▲0.037	▲0.093
3W	-	-	-	▲0.095
1M	▲0.009	0.001	▲0.004	▲0.098
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.104
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29日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)7月連邦公開市場委員会(FOMC) 政策金利	0.25%
-	-	(米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
-	-	(米)4-6月期国内総生産(GDP)速報値 [前期比年率]	8.1%

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▲0.060%~▲0.030%の水準で合出が見られた。都銀・地銀業態などの調達ニーズが若干弱く、同加重平均金利は前日対比▲0.002%の▲0.041%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.060	-	▲0.050 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

ビットサイドの調達ニーズは弱く、出合水準は本日対比で横ばいからやや低下と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月28日	7月29日	7月29日	7月30日	7月30日	7月31日
券	+300		▲800		+1,000	
財政	▲7,800		+3,400		+10,100	
過不足	▲7,500		+2,600		+11,100	
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		+10,000				
国債買入			+10,400			
CP等買入	▲100		▲100			+5,000
社債等買入	▲100					
国債補充供給	+200	▲500	+500			
当座預金増減	+2,000		+13,400		+16,100	
当座預金残高	5,360,300		5,373,700		5,389,800	
準備預金残高	4,673,900		主な需給要因			
積み終了先	4,673,600					
超過準備	4,673,600					
非準備先残高	686,400					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	41.9%					
乖離率	58.0%					

7月28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(7/29~)						
~1年	1,500	4,097	1,500	0.010	0.012	90.8
3~5年	4,500	10,805	4,506	▲0.001	0.000	87.6
5~10年	4,250	13,169	4,257	▲0.003	▲0.002	64.3
国債補充供給(7/28~7/29)						
	438	438	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース (億円)
7月27日時点 6,578,000

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,747,800
7月29日以降の残り所要	
積数	1,700
平均	100

国庫短期証券入札予定

7月30日	3ヶ月 第1012回
8月5日	6ヶ月
8月6日	3ヶ月
8月13日	3ヶ月

国債入札予定

7月29日	2年
8月3日	10年
8月5日	物価連動
8月11日	30年

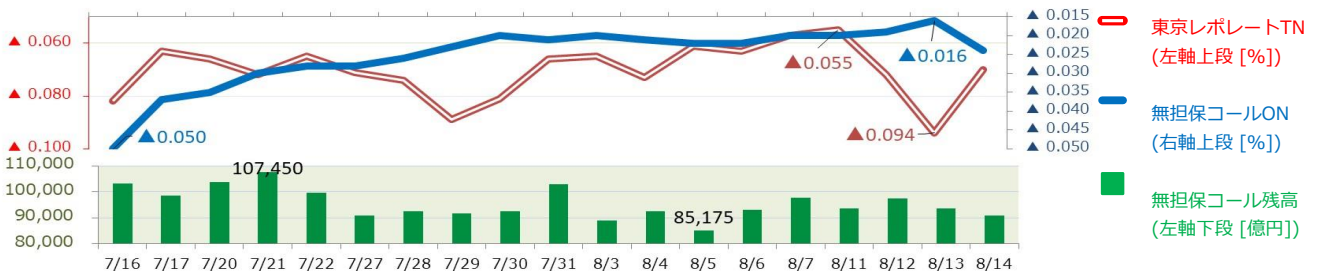
今月の国債買入オペ予定

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