



短期市場の推移

	7月13日	7月14日	7月15日	7月19日
加重平均金利	▲0.007	▲0.007	▲0.014	▲0.019
東京レポレート(TN)	▲0.173	▲0.102	▲0.101	▲0.098
無コール残	139,598	141,567	139,844	136,464
ON	69,615	72,094	73,156	73,586
その他	69,983	69,473	66,688	62,878
有コール残	29,972	29,544	29,392	29,625

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	▲0.060	0.001	▲0.014	▲0.103
T/N	-	-	▲0.010	▲0.138
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.010	▲0.011	▲0.141
2W	▲0.040	0.180	▲0.017	▲0.139
3W	▲0.038	0.000	▲0.023	▲0.146
1M	-	-	▲0.020	▲0.148
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.148
6M	-	-	-	▲0.143
1Y	-	-	-	▲0.137

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)

	日本	予想	海外	予想
-	日銀金融政策決定会合(2日目)	▲0.1%	21:30	(米)新規失業保険申請件数 [前週分]
-	経済・物価情勢の展望(7月、基本的見解)	-	23:00	(米)6月景気先行指数
-	-	-	-	-

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▲0.015%の出合から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.010%の水準で取引された。昨日同様、都銀・地銀業態を中心に資金調達ニーズが強く、ON物加重平均金利(速報)は前日対比+0.005%の▲0.014%となった。本日オファーされた気候変動対応を支援するための資金供給は、貸付予定総額が15,953億円となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.020	▲0.020 ~ ▲0.015	▲0.020 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

引き続き資金調達ニーズは底堅く、出合水準は本日対比横ばいからやや上昇を予想する。

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22日	7月22日	7月22日
券		+200		▲400		▲1,500
財政		▲800		▲8,200		+2,000
過不足		▲600		▲8,600		+500
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
国債買入		+14,600				
共通担保(全店)	▲3,100	+2,300				
CP等買入	▲400		▲200			
社債等買入	▲100		▲100	+1,000		
国債補充供給	+9,200	▲9,700	+9,700			
気候変動対応				+16,000		
当座預金増減		+12,200		+17,800		+500
当座預金残高		5,463,400		5,481,200		5,481,700
準備預金残高		4,762,100				主な需給要因
積み終了先		4,758,200				流動性供給
超過準備		4,758,000				
非準備先残高		701,300				
準備預金進捗率		99.7%				
平均		16.1%				
乖離率		83.5%				

7月20日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(固定利回り方式)(7/21~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(7/20~7/21)						
	9,573	9,573	▲0.350	▲0.350		
	0	0				
気候変動対応(7/21~7/21)						
	15,953	15,953				

マネタリーベース	【億円】
7月19日時点	6,701,400

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,870,200
7月21日以降の残り所要	
積数	12,500
平均	500

国債短期証券入札予定

7月22日	3ヶ月(第1097回)
7月29日	3ヶ月
8月5日	3ヶ月
8月9日	6ヶ月

国債入札予定

7月26日	40年
7月28日	2年
8月2日	10年
8月4日	物価連動

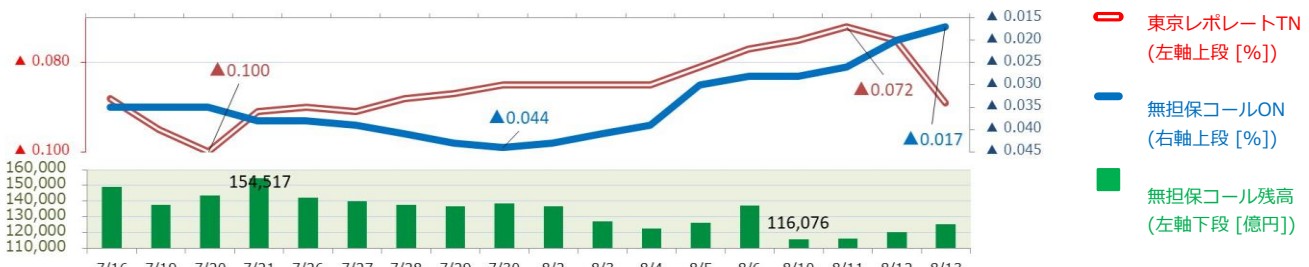
今月の国債買入オペ予定

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	7月6日	-
1年超3年以下	4750	4,750	6 13 19 25	7月19日	1
3年超5年以下	4750	4,750	6 19 25 29	7月19日	2
5年超10年以下	5000	5,000	13 19 25 29	7月19日	2
10年超25年以下	1250	1,250	6 25	7月6日	1
25年超	500	500	13 29	7月13日	1
物価連動債	600	600	月1回	6月29日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	7月13日	-

1年前の市場推移

○2021年7月積み期 [7月16日~8月13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