



<来週の資金需給予想とイベント予定>

(単位：億円)

日付	資金需給予想			主な要因	オペ期日	オペスタート	イベント
	銀行券要因	財政等要因	資金過不足				
7/3 (月)	+ 200	▲ 36,800	▲ 36,600	国債発行・償還 (2年) 国庫短期証券発行・償還 (3M)			日：日銀短観 (6月調査)
7/4 (火)	トン	▲ 47,000	▲ 47,000	法人税・消費税掲げ 保険掲げ			
7/5 (水)	▲ 2,000	▲ 27,000	▲ 29,000	国債発行 (10年)	共通担保 (全店) ▲ 8,910		米：FOMC議事要旨 (6月13、14日開催分) 欧：ユーロ圏PPI (5月)
7/6 (木)	▲ 1,000	トン	▲ 1,000				米：ADP雇用統計 (6月) 新規失業保険申請件数 (7月1日終了週)
7/7 (金)	▲ 1,000	▲ 9,000	▲ 10,000	国債発行 (30年)			日：日銀、コール市場残高 (6月) 米：雇用統計 (6月)

<インターバンク>

日銀当座預金残高は、週初26日は国債買入オペなどを主因に、前営業日対比1兆7,500億円増加の551兆9,600億円から始まった。28日の国債発行や、30日の新型コロナ対応金融支援オペの返済など減少要因が多く、544兆4,500億円 (速報) で越週となった。

無担保コールON物は週を通して取り手が少なく軟調な地合となった。同加重平均金利は週初26日から29日は▲0.076%～▲0.074%のレンジで推移した。四半期末となる30日には、更に取り手が減少し同加重平均は▲0.077% (速報) となった。ターム物は7月スタートの2W物を中心に▲0.070%～▲0.065%の水準で出が見られた。

来週の主な予定は、国内で7月3日に日銀短観 (6月調査) の公表などがあり、海外で5日に米FOMC議事要旨 (6月13、14日開催分) の公表、7日に米雇用統計 (6月) の公表などがある。

[無担保コールレート]

	予想レンジ (%)
O/N	▲0.087 ~ 0.001
1M	▲0.060 ~ 0.0100
2M	▲0.040 ~ 0.050
3M	0.000 ~ 0.130
6M	0.000 ~ 0.150

[オープン市場]

	予想レンジ (%)
現先 (on/1w)	▲0.050 ~ 0.000
CP 3M	0.000 ~ 0.010

<レポ>

足許GCは週初▲0.085%から出会い始め、週を通して▲0.09%～▲0.08%の狭いレンジで推移した。

四半期末過ぎとなる29日の取引でも水準に変化は見られなかった。

SC取引は2年438～449回債、5年149～158回債、10年350～370回債、20年180～184回債、30年65～78回債、40年13～15回債などに引合いが多く見られた。

<CP>

今週の入札発行総額は約3兆円で、週間償還額 (約4兆3,500億円) を大きく下回った。発行市場は、四半期末の有利子負債圧縮を進めたこと等から大幅な償還超となった。発行残高は前週末の27兆18億円から29日時点で26兆7,841億円と減少した。発行レートは一部マイナス圏での発行も見られ、概ね0%から小幅なプラス圏での出会いが中心であった。27日にCP等買入オペが予定通り4,000億円でオフアされた。結果は、按分レート0% (前回△0.007%)、平均落札レート0.014% (前回0.006%) と按分・平均落札レート共に前回比で上昇した。

来週の週間償還額は、約3,300億円となっている。発行市場は、明期への発行再開が本格化することから、発行超を予想する。発行レートは、0%近辺での出会いが中心となることを予想する。

<TDB>

30日の3M (1166回債) の入札は、最高落札利回り▲0.1162% (前回債▲0.1142%)、平均落札利回り▲0.1283% (前回債▲0.1315%) となった。来週は7月6日に6M、7日に3Mの入札が予定されている。