

短期市場の推移

[億円] [%]

	6月30日	7月1日	7月2日	7月3日
加重平均金利	▲0.068	▲0.041	▲0.039	▲0.034
東京レポレート(ON)	▲0.062	▲0.071	▲0.090	▲0.083
無コール残	85,803	94,145	107,297	101,459
ON	64,720	64,117	73,194	66,206
その他	21,083	30,028	34,103	35,253
有コール残	17,950	17,654	18,309	18,048

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。

7月7日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
15:00	コール市場残高(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	▲0.080	0.001	▲0.034	▲0.066
T/N	-	-	-	▲0.068
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.055	0.000	▲0.048	▲0.072
2W	▲0.040	▲0.010	▲0.026	▲0.079
3W	-	-	-	▲0.082
1M	-	-	-	▲0.091
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.106
6M	-	-	-	▲0.160
1Y	-	-	-	▲0.189

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

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.035%の出合から始まり、その後は主に▲0.055%～▲0.030%の水準で出合が見られた。引き続き大手行を中心に調達ニーズが強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.034%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.030	▲0.035 ~ ▲0.030	▲0.055 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

大手行の出合が中心となり、引き続き堅調な地合が継続すると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報 7月6日	日銀予想 7月7日	当社需給予想 7月8日
券	▲100	+500	+0
財政	▲34,500	+7,200	▲7,000
過不足	▲34,600	+7,700	▲7,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+9,200	▲4,200	スタート
CP等買入		▲200	
ETF買入	+1,000		
当座預金増減	▲24,400	+11,700	▲7,000
当座預金残高	4,429,600	4,441,300	4,434,300
準備預金残高	3,835,700	主な需給要因	
積み終了先	3,835,700		
超過準備	3,835,700		
非準備先残高	593,900		
準備預金進捗率	99.9%	国債発行(30年)	
平均	70.0%		
乖離率	29.9%		

7月6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(7/7~)						
5~10年	4,200	8,275	4,203	0.011	0.012	73.0
国債補完供給(7/6~7/7)						
		1	1	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マネタリーベース [億円]
7月3日時点 5,638,900

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,320,800
7月7日以降の残り所要	
積数	500
平均	100

国庫短期証券入札予定

7月9日	6ヶ月	第920回
7月10日	3ヶ月	第921回
7月16日	1年	
7月17日	3ヶ月	
国債入札予定		
7月7日	30年	
7月9日	5年	
7月21日	20年	
7月28日	40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	500~1,500	1,000	月3回程度	7月1日	2
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	3 8 10 17 22 29	7月3日	5
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	1 3 8 17 22 29	7月3日	4
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	6 10 17 22 31	7月6日	4
10年超25年以下	500~2,000	1,200	3 27	7月3日	1
25年超	0~500	300	10 31	6月17日	2
物価連動債	300	300	月2回程度	6月12日	2
変動利付債<偶数月>	1,000	1,000	-	6月3日	-

1年前の市場推移 ○2019年6月積み期 [6月14日~7月12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。