

短期市場の推移

[億円] [%]

	7月9日	7月10日	7月13日	7月14日
加重平均金利	▲0.021	▲0.017	▲0.019	▲0.017
東京レポレート(ON)	▲0.083	▲0.082	▲0.069	▲0.073
無コール残	108,965	110,509	101,629	99,894
ON	71,942	73,546	65,241	63,256
その他	37,023	36,963	36,388	36,638
有コール残	16,500	17,225	17,605	15,850

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16日の予定(時刻は日本時間)

日本			海外		
		予想			予想
14:00	経済・物価情勢の展望 (7月、全文)	－	11:00	(中)4-6月期国内総生産 (GDP)[前年比]	2.6%
17:00	業態別の日銀当座 預金残高(6月)	－	20:45	(欧)7月欧中銀(ECB)政 策金利	0%
	－		21:30	(米)6月小売売上高	5.6%

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	▲0.050	0.001	▲0.014	▲0.074
T/N	-	-	-	▲0.076
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.040	▲0.079
2W	-	-	-	▲0.081
3W	-	-	-	▲0.088
1M	-	-	▲0.030	▲0.095
2M	-	-	0.005	-
3M	-	-	0.130	▲0.106
6M	-	-	-	▲0.156
1Y	-	-	-	▲0.175

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▲0.015%の出合から始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.01%の水準で出合が見られた。引き続き都銀・信託業態を中心とした調達ニーズが強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.003%の▲0.014%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.013	▲0.020 ~ ▲0.010	▲0.050 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

新積み期となることで、ビッドサイドの動きは慎重になるだろう。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	7月15日	7月16日	7月17日
券	+100	▲1,100	▲1,000
財政	▲16,100	+2,100	▲3,000
過不足	▲16,000	+1,000	▲4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+30,000		
CP等買入	▲400		
社債等買入	▲100		
ETF買入		+100	
被災地金融機関支援		▲1,100	+100
米ドル資金供給用担保国債供給	▲4,400	+23,200	
当座預金増減	+9,100	+1,100	+18,200
当座預金残高	4,459,700	4,460,800	4,479,000
準備預金残高	3,848,700	主な需給要因	
積み終了先	3,848,700		
超過準備	3,848,700		
非準備先残高	611,000		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	100.0%		
乖離率	0.0%		

7月15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(7/15~7/16)		0	0	0		

マネタリーベース[億円]	所要
7月14日時点 5,634,100	来積み期の所要準備額 3,473,200
	7月16日以降の残り所要 積数 3,473,200
	平均 112,000

国庫短期証券入札予定

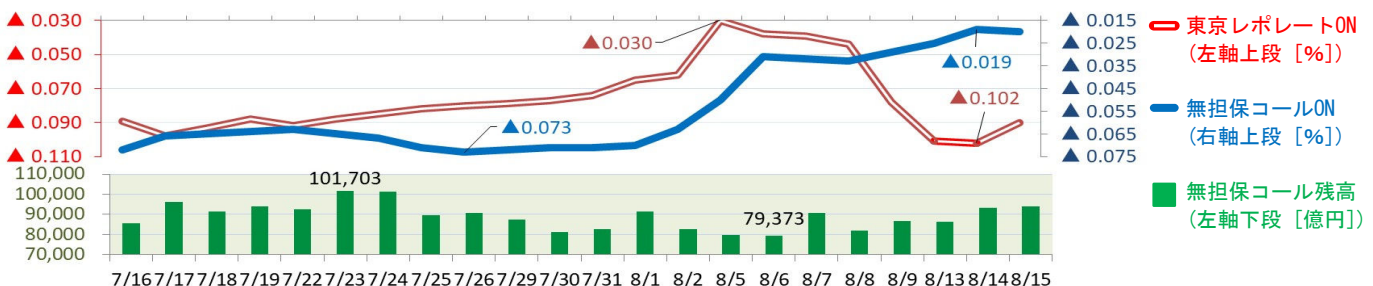
7月16日	1年	第922回
7月17日	3ヶ月	第923回
7月21日	6ヶ月	第924回
7月22日	3ヶ月	第925回
7月21日	20年	
7月28日	40年	
7月30日	2年	
8月4日	10年	

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8日	1
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	3 8 10 17 22 29	7月10日	3
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	1 3 8 17 22 29	7月8日	3
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	6 10 17 22 31	7月10日	3
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	7月10日	1
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7月積み期[7月16日~8月15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。