

短期市場の推移

[億円] [%]

	7月14日	7月15日	7月16日	7月17日
加重平均金利	▲0.017	▲0.014	▲0.050	▲0.037
東京レポレート(ON)	▲0.073	▲0.074	▲0.072	▲0.082
無コール残	99,894	98,438	103,117	98,409
ON	63,256	64,610	71,559	65,691
その他	36,638	33,828	31,558	32,718
有コール残	15,850	15,986	18,094	18,141

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	▲0.035	▲0.066
T/N	-	-	-	▲0.066
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.001	▲0.014	▲0.070
2W	▲0.035	0.000	▲0.026	▲0.076
3W	-	-	-	▲0.083
1M	-	-	▲0.040	▲0.091
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.103
6M	-	-	-	▲0.152
1Y	-	-	-	▲0.178

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
8:30	6月消費者物価コア指数 [前年比]	▲0.1%	-	-	-
	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-

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▲0.030%の出合から始まり、その後は主に▲0.040%～▲0.030%の水準で出合が見られた。引き続き地銀業態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+0.002%の▲0.035%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.037	▲0.040 ~ ▲0.038	▲0.045 ~ ▲0.028

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達ニーズは強く、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20日	日銀予想 7月21日	当社需給予想 7月22日
券	▲1,200	▲1,300	▲1,000
財政	▲40,000	+1,300	▲4,000
過不足	▲41,200	+0	▲5,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+25,000	スタート
国債買入	▲300	▲200	
CP等買入		▲200	
社債等買入			
ETF買入		+200	
国債補完供給	▲200	+200	
当座預金増減	▲29,300	+31,000	▲5,000
当座預金残高	4,460,600	4,491,600	4,486,600
準備預金残高	3,845,900	主な需給要因	
積み終了先	3,843,600	国債発行(20年)	
超過準備	3,842,800		
非準備先残高	614,700		
準備預金進捗率	99.7%		
平均	16.1%		
乖離率	83.6%		

7月20日のオペ結果 [円][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
国庫短期証券買入(7/21~)	25,000	50,077	25,006	0.001	0.004	2.6
国債補完供給(7/20~7/21)		150	150	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マネタリーベース [億円]
7月17日時点 5,675,300

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,473,200
7月21日以降の残り所要	
積数	9,800
平均	400

国庫短期証券入札予定

7月21日	16ヶ月	第924回
7月22日	3ヶ月	第925回
7月31日	3ヶ月	
8月6日	16ヶ月	

国債入札予定

7月21日	20年
7月28日	40年
7月30日	2年
8月4日	10年

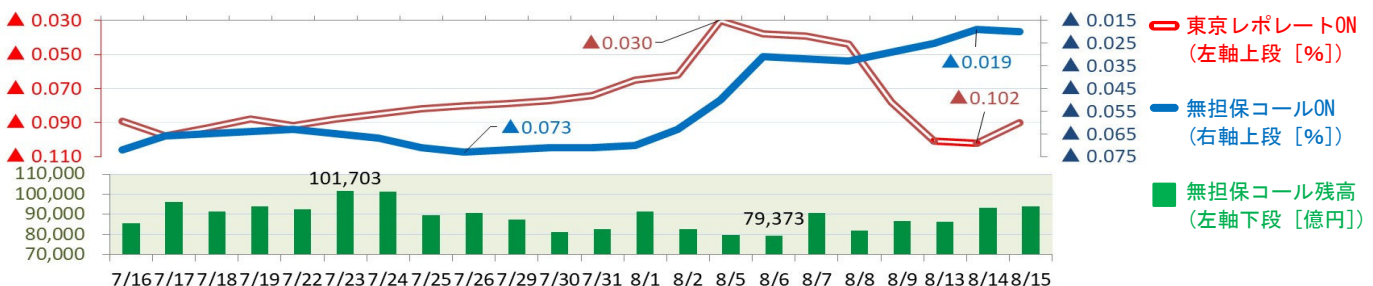
今月の国債買入オペ予定

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