

短期市場の推移

[億円] [%]

7月1日の予定 (時刻は日本時間)

	6月24日	6月25日	6月26日	6月27日
加重平均金利	▲0.066	▲0.066	▲0.068	▲0.070
東京レポレート(ON)	▲0.092	▲0.088	▲0.086	▲0.085
無コール残	93,555	99,155	94,762	96,207
ON	56,665	62,885	52,452	54,547
その他	36,890	36,270	42,310	41,660
有コール残	22,397	23,877	26,774	31,479

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	▲0.150	0.001	▲0.076	▲0.088
T/N	-	-	-	▲0.081
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.072	0.000	▲0.055	▲0.087
2W	▲0.065	▲0.005	▲0.057	▲0.090
3W	-	-	-	▲0.100
1M	▲0.065	0.001	▲0.052	▲0.106
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.123
6M	-	-	-	▲0.150
1Y	-	-	-	▲0.158

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、▲0.080%の合出から始まり、その後は主に▲0.086%～▲0.065%のレンジで取引された。四半期末で調達を控える先が多く、軟調な地合いとなり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.006%の▲0.076%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.080		▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.085 ~ ▲0.065

翌営業日のマーケット

月末に調達を控えていた先が戻ってくることで、出合水準は上昇すると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	6月28日	7月1日	7月2日
券	▲900	+600	+1,000
財政	▲1,600	▲29,600	▲6,000
過不足	▲2,500	▲29,000	▲5,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+7,800	スタート
共通担保(全店)		+700	
CP等買入	▲2,800	+2,500	
当座預金増減	▲2,800	▲21,100	▲5,000
当座預金残高	4,107,900	4,086,800	4,081,800
準備預金残高	3,584,500	主な需給要因	
積み終了先	3,584,300		
超過準備	3,584,000		
非準備先残高	523,400		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	50.0%		
乖離率	49.9%		

6月28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(7/1~)					
5~10年	4,800	10,518	4,805	▲0.019	▲0.015
10~25年	2,000	5,069	2,004	▲0.018	▲0.016
25年~	400	1,833	404	▲0.021	▲0.019

国債補完供給(6/28~7/1)					
195,159	28	28	▲0.350	▲0.350	
10,070	0	0			

共通担保(全店)(7/1~7/16)					
15,000	655	655			

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
6月27日時点 5,235,600	今積期の所要準備額 3,083,000
	7月1日以降の残り所要
	積数 3,100
	平均 200

国庫短期証券入札予定

7月5日	3ヶ月	第842回
7月9日	6ヶ月	
7月12日	3ヶ月	
7月18日	1年	
国債入札予定		
7月2日	10年	
7月4日	30年	
7月9日	5年	
7月17日	20年	

来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	100~1,000 程度	500	月2回程度	6月19日	2
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	3 10 21 26	6月26日	4
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	7 14 21 28	6月28日	4
10年超25年以下	1,000~3,000 程度	2,000	7 19 28	6月28日	3
25年超	100~1,000 程度	400			
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	6月26日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	6月14日	-

1年前の市場推移

○2018年6月積み期 [6月15日~7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。