

短期市場の推移

[億円] [%]

	6月27日	6月28日	7月1日	7月2日
加重平均金利	▲0.070	▲0.076	▲0.071	▲0.071
東京レポレート(ON)	▲0.085	▲0.088	▲0.091	▲0.089
無コール残	96,207	55,487	83,488	84,423
ON	54,547	36,307	56,133	52,223
その他	41,660	19,180	27,355	32,200
有コール残	31,479	21,553	21,695	23,056

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4日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)休場(独立記念日)	-
-	-	18:00 (欧)5月小売売上高[前月比]	-
-	-	-	-

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	▲0.085	0.001	▲0.071	▲0.083
T/N	-	-	-	▲0.082
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.075	0.001	▲0.045	▲0.085
2W	▲0.070	▲0.010	▲0.032	▲0.090
3W	-	-	-	▲0.098
1M	-	-	-	▲0.105
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.124
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、▲0.075%の合出から始まり、その後は主に▲0.08~▲0.075%のレンジで取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.071%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.075	▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.080 ~ ▲0.065

翌営業日のマーケット

調達サイドの動向に大きな変化はなく、出合の水準は本日と横ばいを予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報 7月3日	日銀予想 7月4日	当社需給予想 7月5日
券	+300	▲700	+0
財政	▲45,700	▲1,100	▲7,000
過不足	▲45,400	▲1,800	▲7,000
金融調節	エンド スタート	エンド スタート	エンド スタート
国庫短期証券買入	+2,500	-	-
国債買入	-	▲100	+10,400
CP等買入	-	▲300	-
国債補完供給	▲300	+300	-
当座預金増減	▲43,200	+8,800	▲7,000
当座預金残高	4,039,400	4,048,200	4,041,200
準備預金残高	3,544,200	3,543,900	3,543,900
積み終了先	3,543,900	3,543,900	3,543,900
超過準備	3,543,900	3,543,900	3,543,900
非準備先残高	495,200	495,200	495,200
準備預金進捗率	99.9%	99.9%	99.9%
平均	60.0%	60.0%	60.0%
乖離率	39.9%	39.9%	39.9%

7月3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(7/4~)						
1~3年	3,800	14,435	3,807	▲0.005	▲0.004	56.4
3~5年	3,800	13,213	3,800	▲0.021	▲0.017	24.9
10~25年	1,800	4,855	1,807	▲0.028	▲0.025	25.6
25年~	400	1,543	405	▲0.029	▲0.027	32.5
国債補完供給(7/3~7/4)						
	531,985	278	278	▲0.350	▲0.350	

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
7月2日時点 5,207,100	今積期の所要準備額 3,083,000
	7月4日以降の残り所要
	積数 2,300
	平均 200

国庫短期証券入札予定

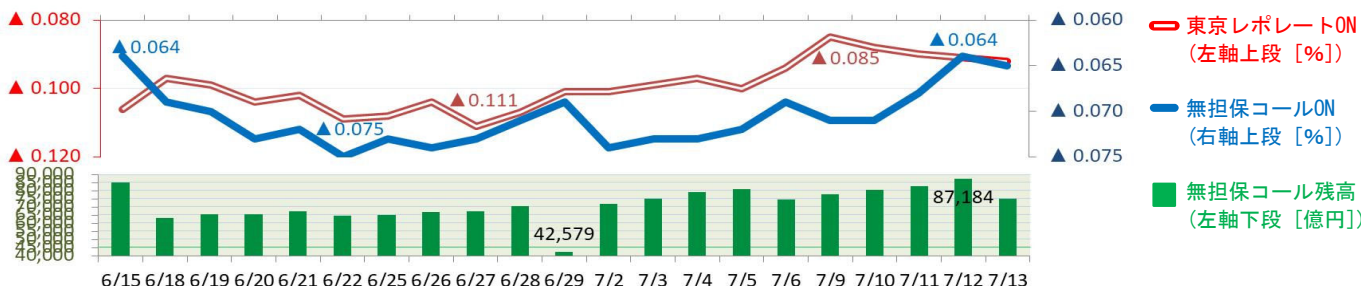
7月5日	3ヶ月	第842回
7月9日	6ヶ月	第843回
7月12日	3ヶ月	
7月18日	1年	

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	100~1,000 程度	500	月2回程度	6月19日	2
1年超3年以下	2,500~5,000 程度	3,800			
3年超5年以下	2,500~5,000 程度	3,800	3 12 22 31	7月3日	3
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	5 16 22 31	6月28日	4
10年超25年以下	1,000~2,500 程度	1,800	3 12 26	7月3日	2
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		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。