

短期市場の推移

[億円] [%]

	7月10日	7月11日	7月12日	7月16日
加重平均金利	▲0.077	▲0.076	▲0.076	▲0.072
東京レポレート(ON)	▲0.100	▲0.103	▲0.094	▲0.089
無コール残	79,201	77,704	80,108	85,712
ON	40,701	41,574	44,193	55,102
その他	38,500	36,130	35,915	30,610
有コール残	22,739	22,316	21,977	21,400

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18日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	6月貿易収支	4,060億円	(米)NY連銀総裁の講演	
8:50	主要銀行貸出動向アンケート調査(7月)	-	(米)新規失業保険申請件数[前週分]	-
14:00頃	実質輸出入の動向	-	(米)6月景気先行指数	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	▲0.066	▲0.098
T/N	-	-	-	▲0.098
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.040	▲0.048	▲0.100
2W	▲0.050	▲0.010	▲0.030	▲0.101
3W	-	-	-	▲0.104
1M	▲0.045	▲0.040	▲0.044	▲0.109
2M	-	-	-	-
3M	-	-	▲0.040	▲0.125
6M	-	-	-	▲0.149
1Y	-	-	-	▲0.160

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%の出合から始まった。その後は主に▲0.075%~▲0.060%の水準で取引された。ビッドサイドの調達ニーズが昨日と比べやや強くなり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.006%の▲0.066%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.065		▲0.070 ~ ▲0.065	▲0.075 ~ ▲0.060

翌営業日のマーケット

調達ニーズは引き続き堅調で、出合の水準は小幅上昇と予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月17日	7月18日	7月17日	7月18日	7月19日	7月19日
券	+1,100	▲400		▲400		+0
財政	▲1,300	▲8,900		▲8,900		+2,000
過不足	▲200	▲9,300		▲9,300		+2,000
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		+5,000				
CP等買入	▲200		▲100			
社債等買入			▲100			
ETF買入		+700				
被災地金融機関支援					▲1,100	+1,100
国債補充供給	+400	▲200	+200			
当座預金増減		+5,500		▲6,800		+2,000
当座預金残高	4,028,200		4,021,400		4,023,400	
準備預金残高	3,493,600					
積み終了先	3,415,600					
超過準備	2,981,300					
非準備預金残高	534,600					
準備預金進捗率	96.2%					
平均	6.5%					
乖離率	89.8%					

7月17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	接分
国庫短期証券買入(7/18~)	2,500	11,310	2,503	0.008	0.009	82.3
社債等買入(7/23~)	1,250	2,287	1,250	▲0.084	▲0.063	64.4
国債補充供給(7/17~7/18)	91,799	169	169	▲0.350	▲0.350	
	2,385	9	9	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
7月16日時点 5,145,500	今積期の所要準備額 3,193,500
	7月18日以降の残り所要積数 120,000
	平均 4.100

国庫短期証券入札予定

7月18日	1年	第845回
7月19日	3ヶ月	第846回
7月26日	3ヶ月	
8月2日	3ヶ月	
7月23日	40年	
7月25日	2年	
8月1日	10年	
8月6日	30年	

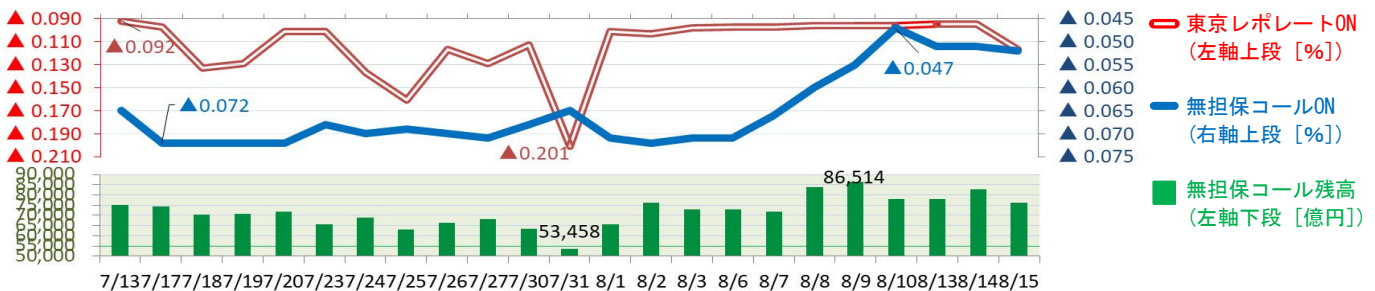
今月の国債買入オペ予定

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	7月5日	1
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12日	2
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	5 16 22 31	7月16日	2
10年超25年以下	1,000~2,500 程度	1,800			
25年超	100~1,000 程度	400	3 12 26	7月12日	1
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	7月5日	1
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7月積み期 [7月13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。投資については最終決定は、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。