

短期市場の推移

	7月4日	7月5日	7月8日	7月9日
加重平均金利	▲0.072	▲0.074	▲0.075	▲0.076
東京レポレート(ON)	▲0.082	▲0.097	▲0.115	▲0.110
無コール残	90,145	85,810	80,280	78,903
ON	54,070	50,270	45,165	41,513
その他	36,075	35,540	35,115	37,390
有コール残	23,463	21,772	18,492	18,377

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11日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 (米)6月消費者物価コア指数 [前年比]	2.0%
-	-	21:30 (米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
-	-	-	-

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	▲0.086	0.001	▲0.077	▲0.100
T/N	-	-	▲0.086	▲0.105
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.065	▲0.025	▲0.031	▲0.106
2W	▲0.045	▲0.015	▲0.020	▲0.107
3W	-	-	-	▲0.108
1M	-	-	▲0.045	▲0.111
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.127
6M	-	-	-	▲0.151
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、▲0.085%の出合から始まり、その後は主に▲0.086~▲0.08%の水準で取引された。ビッドサイドの資金調達ニーズは減退しており、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.077%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.086 ~ ▲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

	日銀速報 7月10日	日銀予想 7月11日	当社需給予想 7月12日
券	+500	▲1,000	▲1,000
財政	▲26,900	▲5,600	▲21,000
過不足	▲26,400	▲6,600	▲22,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲200	▲100	+2,000
国債補充供給	▲100	+100	-
当座預金増減	▲26,700	▲6,600	▲20,000
当座預金残高	4,034,200	4,027,600	4,007,600
準備預金残高	3,518,500	主な需給要因	
積み終了先	3,518,400	源泉税揚げ	
超過準備	3,518,300		
非準備先残高	515,700		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	83.3%		
乖離率	16.6%		

7月10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
国債補充供給(7/10~7/11)	154,088	107	107	▲0.350	▲0.350	-

マナタリーベース [億円]
7月9日時点 5,183,800

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,088,800
7月11日以降の残り所要積数 500
平均 100

国庫短期証券入札予定

7月12日	3ヶ月	第844回
7月18日	1年	
7月19日	3ヶ月	
7月26日	3ヶ月	
7月17日	20年	
7月23日	40年	
7月25日	2年	
8月1日	10年	

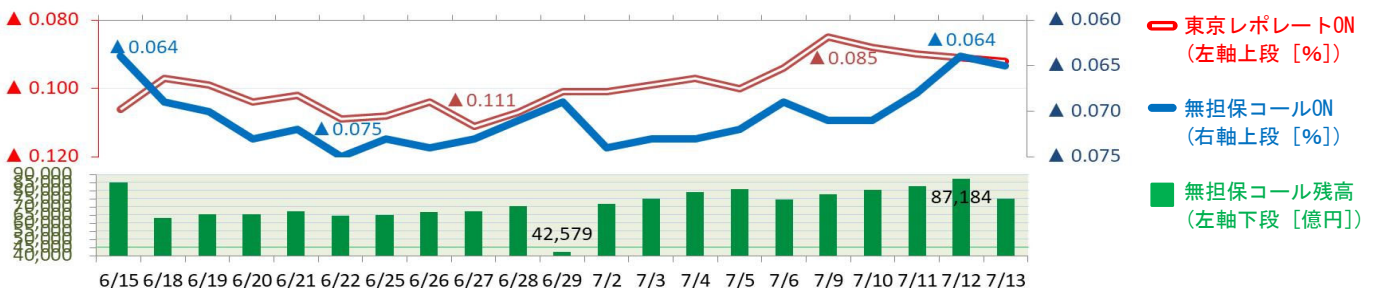
今月の国債買入オペ予定

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	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3日	3
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	5 16 22 31	7月5日	3
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3日	2
物価運動債	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。