

短期市場の推移

[億円] [%]

	7月23日	7月24日	7月25日	7月26日
加重平均金利	▲0.065	▲0.067	▲0.071	▲0.073
東京レポレート(ON)	▲0.088	▲0.085	▲0.082	▲0.080
無コール残	101,703	101,113	89,602	90,685
ON	62,728	61,488	56,737	57,120
その他	38,975	39,625	32,865	33,565
有コール残	23,137	22,047	22,216	21,216

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30日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀金融政策決定会合 (2日目)		FOMC(31日まで)	
経済・物価情勢の展望 (7月、基本的見解)		(米)7月消費者信頼感指数	124.4
8:30 6月失業率	+2.4%	-	

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	▲0.072	▲0.079
T/N	-	-	▲0.080	▲0.079
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.050	▲0.084
2W	-	-	▲0.040	▲0.086
3W	-	-	-	▲0.089
1M	-	-	-	▲0.097
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.114
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 outage から始まった。その後は主に▲0.080%~▲0.065%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.072%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.080	▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.080 ~ ▲0.065

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達動向に大きな変化はなく、横ばいの地合を予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月29日	7月30日	7月30日	7月31日	7月31日	7月31日
券		+100		+100		▲400
財政		+5,900		+100		+4,300
過不足		+6,000		+200		+3,900
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
国債買入		+3,200				
共通担保(全店)	▲700	+700				
CP等買入	▲400					+2,500
社債等買入	▲100		▲100			
ETF買入		+800		+400		
国債補完供給	+100					
当座預金増減		+9,600		+500		+6,400
当座預金残高		4,055,800		4,056,300		4,062,700
準備預金残高		3,559,400	主な需給要因			
積み終了先		3,557,700				
超過準備		3,557,700				
非準備預金残高		496,400				
準備預金進捗率		99.8%				
平均		45.2%				
乖離率		54.7%				

7月29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
国債補完供給(7/29~7/30)	15,996	48	48	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]
7月26日時点 5,169,800

所要	所要準備額
今積期の所要準備額	3,193,500
7月30日以降の残り所要積数	5,400
平均	300

国庫短期証券入札予定

8月2日	3ヶ月	第848回
8月8日	6ヶ月	
8月9日	3ヶ月	
8月16日	3ヶ月	
8月1日	10年	
8月6日	30年	
8月8日	物価運動	
8月15日	5年	

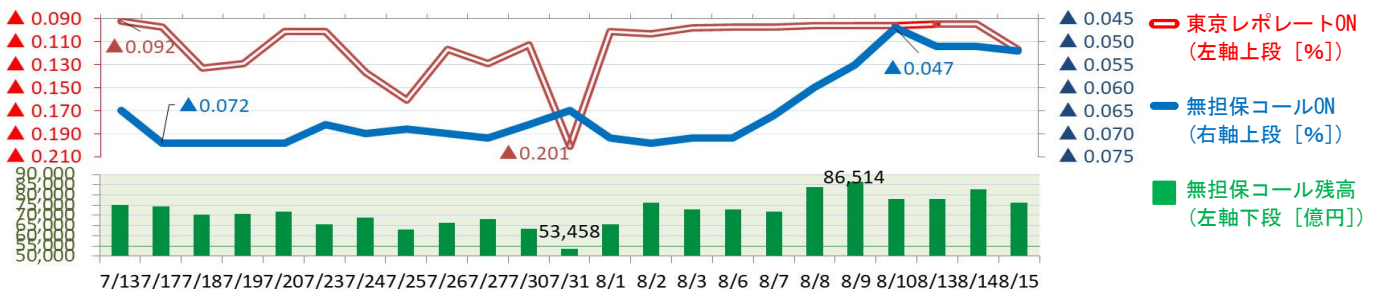
今月の国債買入オペ予定

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26日	0
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22日	1
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	5 16 22 31	7月22日	1
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26日	0
物価運動債	250 程度	250	月2回程度	7月22日	0
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。