

短期市場の推移

	6月25日	6月26日	6月27日	6月28日
加重平均金利	▲0.073	▲0.074	▲0.073	▲0.071
東京レポレート(ON)	▲0.108	▲0.104	▲0.111	▲0.107
無コール残	65,099	66,969	67,501	70,588
ON	33,979	35,964	36,681	41,518
その他	31,120	31,005	30,820	29,070
有コール残	18,214	19,464	17,952	17,959

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2日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	短観(6月概要)	-	23:00 (米)6月ISM製造業景気指数	58.0
8:50	短観(6月要旨)	-	18:00 (欧)5月生産者物価指数[前年比]	3.0%
8:50	4-6月期日銀短観(大企業製造業DI)	22	-	-

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	▲0.069	▲0.101
T/N	-	-	0.000	▲0.103
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.065	0.001	▲0.032	▲0.113
2W	▲0.055	▲0.040	▲0.048	▲0.116
3W	-	-	-	▲0.121
1M	-	-	0.010	▲0.126
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.005	▲0.136
6M	-	-	-	▲0.149
1Y	-	-	-	▲0.159

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

無担保コールON物は▲0.086%の出合から始まったものの、四半期末日にあたることから資金調達を控える先が多く、▲0.086%のオファーが出し残る展開となった。前営業日より▲0.08%台のビッドが薄く、その水準の取引量が減少したことから、同加重平均金利は前営業日対比+0.002%の▲0.069%となった。

O/N業態別出合レンジ

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲ 0.086 ~ ▲ 0.086	▲ 0.085 ~ ▲ 0.065

翌営業日のマーケット

本日と比較するとビッドサイドは増加するが、引き続き軟調な地合を予想する。取引のレンジは▲0.086%~▲0.05%で取引されると予想。

資金需給

	日銀速報 6月29日	日銀予想 7月2日	当社需給予想 7月3日
券	▲800	+300	+0
財政	+5,300	▲28,400	▲5,000
過不足	+4,500	▲28,100	▲5,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+9,700
共通担保(全店)		▲2,400	+2,400
CP等買入	▲3,600	+2,500	
ETF買入	+2,400		+100
国債補完供給	+1,400	+1,400	
当座預金増減	+5,800	▲16,900	▲5,000
当座預金残高	3,936,500	3,919,600	3,914,600
準備預金残高	3,440,600	主な需給要因	
積み終了先	3,440,400		
超過準備	3,440,300	国債発行(2年)	法人税・消費税・保険揚げ
非準備預金残高	495,900	国庫短期証券発行・償還(3M)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	53.3%		
乖離率	46.6%		

6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
国債買入(7/2~)						
1~3年	2,500	11,561	2,506	0.002	0.003	54.9
3~5年	3,000	8,926	3,004	0.003	0.003	63.9
5~10年	4,100	14,827	4,106	0.006	0.007	30.9
国債補完供給(6/29~7/2)						
	115,771	1,314	1,314	▲0.600	▲0.600	
	5,410	0	0			
共通担保(全店)(7/2~7/17)						
	8,000	2,382	2,382			

マナタリーベース [億円]
6月28日時点 5,022,900

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,018,100
7月2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

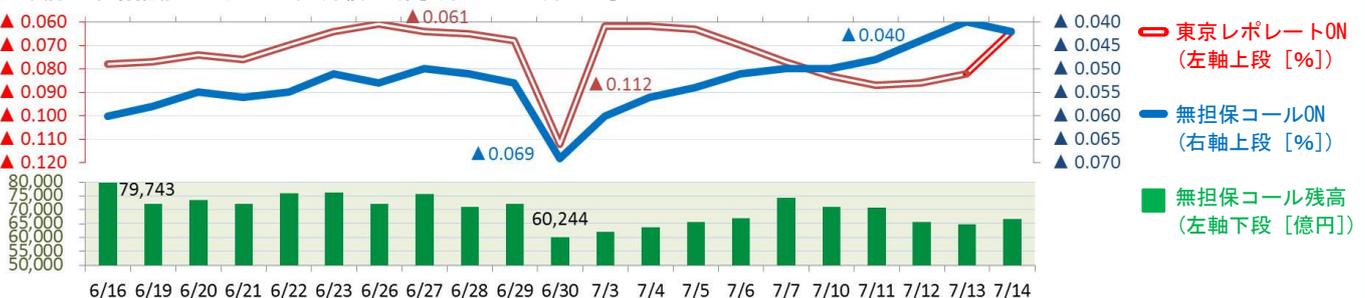
7月6日	3ヶ月	第768回
7月9日	6ヶ月	
7月13日	3ヶ月	
7月19日	1年	
国債入札予定		
7月3日	10年	
7月5日	30年	
7月10日	5年	
7月12日	20年	

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13日	2
1年超3年以下	2,000~3,000 程度	2,500			
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,000	4 6 11 17 23 27	6月29日	6
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,100	4 11 13 19 25 27	6月29日	5
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,900			
25年超	500~1,500 程度	700	2 6 13 19 25	6月27日	5
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	6月13日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	6月8日	1

1年前の市場推移

○2017年6月積み期 [6月16日~7月14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。