

短期市場の推移

[億円] [%]

	6月26日	6月27日	6月28日	6月29日
加重平均金利	▲0.074	▲0.073	▲0.071	▲0.069
東京レポレート(ON)	▲0.104	▲0.111	▲0.107	▲0.101
無コール残	66,969	67,501	70,588	42,579
ON	35,964	36,681	41,518	27,059
その他	31,005	30,820	29,070	15,520
有コール残	19,464	17,952	17,959	22,141

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3日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	短観(6月調査全容)	-	13:30 (豪)7月豪中銀(RBA)政策金利	1.5%
8:50	マナタリーベース(6月)	-	18:00 (欧)5月小売売上高[前月比]	0.3%
10:00	営業毎旬報告(6月30日現在)	-	-	-

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	▲0.074	▲0.101
T/N	-	-	0.000	▲0.103
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	▲0.032	▲0.062	▲0.108
2W	▲0.070	0.000	▲0.045	▲0.111
3W	-	-	-	▲0.116
1M	▲0.025	0.030	▲0.015	▲0.122
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.132
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。その後はビッドサイドが厚くなり、▲0.086~▲0.080%までの出合が多く見られた。前営業日より▲0.08%台の出合が増加したため、同加重平均金利は前営業日対比▲0.004%の▲0.073%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	▲0.086 ~ ▲0.085	▲0.086 ~ ▲0.065

翌営業日のマーケット

税揚げ前倒し要因等を背景に地銀業態を中心にビッドサイドがやや厚くなると思われるため、ON物加重平均金利は上昇すると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報 7月2日	日銀予想 7月3日	当社需給予想 7月4日
券	+400	▲300	+0
財政	▲27,800	▲8,500	▲42,000
過不足	▲27,400	▲8,800	▲42,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+5,000
国債買入			+3,400
共通担保(全店)	▲2,400	+2,400	
ETF買入		+100	
国債補完供給	+1,400	+1,400	
当座預金増減	▲17,600	+1,000	▲42,000
当座預金残高	3,918,900	3,919,900	3,877,900
準備預金残高	3,416,600	主な需給要因	
積み終了先	3,416,400	法人税	法人税
超過準備	3,416,400	消費税	消費税
非準預先残高	502,300	保険揚げ	保険揚げ
準備預金進捗率	99.9%	国債発行	国債発行(10年)
平均	56.7%		
乖離率	43.2%		

7月2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(7/3~)	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
5.000	17,342	5,003	▲0.002	▲0.001	17.1	
国債買入(7/3~)						
~1年	500	4,002	500	0.018	0.018	98.0
10~25年	1,900	5,939	1,907	0.002	0.002	64.9
25年~	700	2,441	707	0.002	0.002	83.0
物価連動	250	1,958	252	▲0.060	▲0.069	44.6
国債補完供給(7/2~7/3)						
92,048	769	769	▲0.600	▲0.600		
112,240	551	551	▲0.600	▲0.600		

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
6月29日時点 5,029,400	今積期の所要準備額 3,018,100
	7月3日以降の残り所要積数 2,100
	平均 200

国庫短期証券入札予定

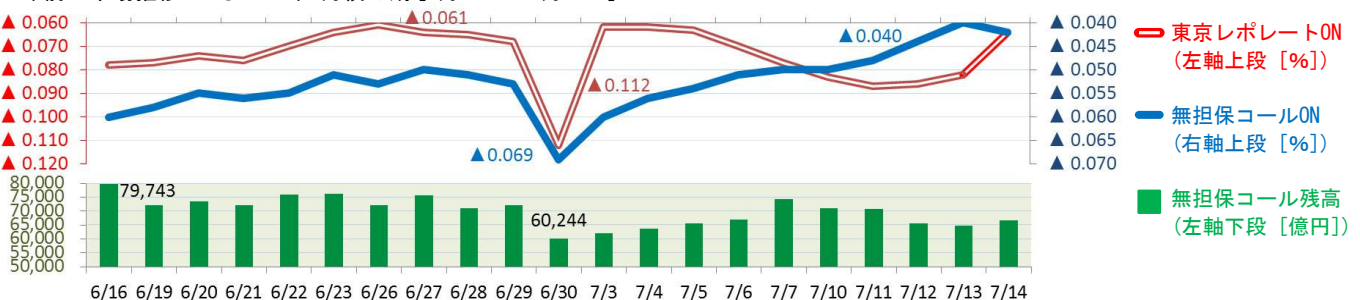
7月6日	3ヶ月	第768回
7月9日	6ヶ月	第769回
7月13日	3ヶ月	
7月19日	1年	
7月3日	10年	
7月5日	30年	
7月10日	5年	
7月12日	20年	

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2日	1
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	6
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	7月2日	4
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	7月2日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	6月8日	-

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。