

短期市場の推移

	7月4日	7月5日	7月6日	7月9日
加重平均金利	▲0.073	▲0.072	▲0.069	▲0.071
東京レポレート(ON)	▲0.097	▲0.100	▲0.094	▲0.085
無コール残	79,370	80,846	74,870	77,684
ON	50,330	50,731	44,955	47,869
その他	29,040	30,115	29,915	29,815
有コール残	27,722	24,201	30,405	32,795

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
8:50 6月国内企業物価指数[前年比]	2.7%	20:00 (米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]	-
8:50 5月機械受注[前月比]	▲5.5%	21:30 (米)6月生産者物価コア指数[前年比]	2.6%
-	-	(米)ウイリアムズNY連銀総裁講演	-

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	▲0.071	▲0.088
T/N	-	-	0.000	▲0.088
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.055	0.001	▲0.047	▲0.096
2W	-	-	-	▲0.104
3W	-	-	-	▲0.111
1M	-	-	-	▲0.117
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.130
6M	-	-	-	▲0.148
1Y	-	-	-	▲0.157

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▲0.08%の出合から始まった。その後の出合レンジは昨日と横ばい圏の▲0.086~▲0.05%で取引された。同加重平均金利は前営業日対比横ばいの▲0.071%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	▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.086 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

引き続き、積み最終日に向けて地銀業態を中心に積極的な調達が見られると予想するため、▲0.05%台の出合は増加方向か。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	7月10日	7月11日	7月12日
券	+100	+300	▲1,000
財政	+1,000	▲29,600	▲18,000
過不足	+1,100	▲29,300	▲19,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+7,500	
CP等買入	▲100	▲200	
ETF買入			
国債補完供給	+200	+500	
当座預金増減	+3,200	▲21,500	▲19,000
当座預金残高	3,887,500	3,866,000	3,847,000
準備預金残高	3,434,500	主な需給要因	
積み終了先	3,434,300		
超過準備	3,434,300		
非準備先残高	453,000		
準備預金進捗率	99.9%	国債発行(5年)	源泉税揚げ
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
国庫短期証券買入(7/11~)	7,500	23,486	7,503	0.000	0.001	75.0
米ドル資金供給(7/12~7/19)	0	0	2,410	2,410		
国債補完供給(7/10~7/11)	6,570	2	2	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]
7月9日時点 4,976,100

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,031,300
7月11日以降の残り所要積数 600
平均 100

国庫短期証券入札予定

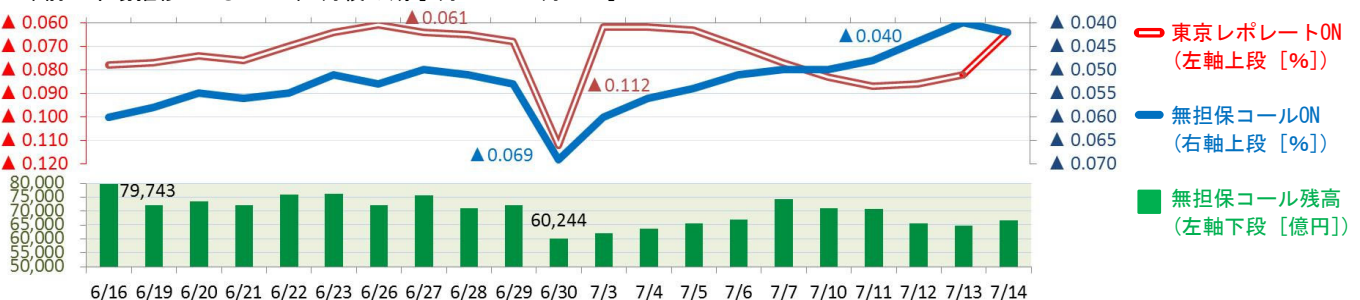
7月13日	3ヶ月	第770回
7月19日	1年	
7月20日	3ヶ月	
7月27日	3ヶ月	
国債入札予定		
7月12日	20年	
7月24日	40年	
7月26日	2年	
8月2日	10年	

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	7月6日	4
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,100	4 11 13 19 25 27	7月4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	7月6日	3
物価運動債	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。