

短期市場の推移

	7月6日	7月9日	7月10日	7月11日
加重平均金利	▲0.069	▲0.071	▲0.071	▲0.068
東京レポレート(ON)	▲0.094	▲0.085	▲0.088	▲0.090
無コール残	74,870	77,684	80,428	82,935
ON	44,955	47,869	49,713	51,920
その他	29,915	29,815	30,715	31,015
有コール残	30,405	32,795	27,809	31,323

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13日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	23:00 (米)7月ミシガン大学消費者信頼感速報	98.2
-	-	-	-
-	-	-	-

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	▲0.064	▲0.091
T/N	▲0.045	0.000	▲0.038	▲0.099
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.065	▲0.045	▲0.052	▲0.102
2W	▲0.040	0.160	0.008	▲0.109
3W	-	-	▲0.020	▲0.114
1M	-	-	-	▲0.120
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.130
6M	-	-	-	▲0.149
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▲0.075%の出合から始まり、その後は主に▲0.08~▲0.045%の水準で取引された。積み期終盤であることから資金調達意欲が高く、地銀業態を中心に▲0.04%台の出合が多く見られたため、同加重平均金利は前営業日対比+0.004%の▲0.064%となった。

O/N業態別出合レンジ

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.073	▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.075 ~ ▲0.045

翌営業日のマーケット

ON物は来積み期にかかるところから資金調達ニーズは限定的と思われる、加重平均金利は本日対比低下するものと予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月12日	7月13日	7月13日	7月17日	7月17日	7月17日
券	▲1,100	▲600	▲600	+1,000	+1,000	+1,000
財政	▲21,800	+100	+100	+7,000	+7,000	+7,000
過不足	▲22,900	▲500	▲500	+8,000	+8,000	+8,000
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	-	+9,700	-	-	-	-
共通担保(全店)	▲200	-	▲100	▲2,400	▲2,400	▲2,400
CP等買入	-	+800	-	+600	+600	+600
ETF買入	-	-	-	-	-	-
国債補完供給	+200	▲500	+500	-	-	-
当座預金増減	▲12,900	+500	+500	+5,600	+5,600	+5,600
当座預金残高	3,852,200	3,852,700	3,852,700	3,858,300	3,858,300	3,858,300
準備預金残高	3,429,100	3,429,100	3,429,100	3,429,100	3,429,100	3,429,100
積み終了先	3,429,000	3,429,000	3,429,000	3,429,000	3,429,000	3,429,000
超過準備	3,429,000	3,429,000	3,429,000	3,429,000	3,429,000	3,429,000
非準備先残高	423,100	423,100	423,100	423,100	423,100	423,100
準備預金進捗率	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%
平均	90.0%	90.0%	90.0%	90.0%	90.0%	90.0%
乖離率	9.9%	9.9%	9.9%	9.9%	9.9%	9.9%

7月12日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
CP等買入(7/18~)	2,000	6,295	1,990	▲0.003	▲0.001	26.9
国債補完供給(7/12~7/13)	131,214	458	458	▲0.600	▲0.600	-
	10,000	27	27	▲0.600	▲0.600	-

マナタリーベース [億円]
 7月11日時点 4,956,500

所要 [億円]
 今積期の所要準備額 3,031,300
 7月13日以降の残り所要積数 300
 平均 100

国庫短期証券入札予定

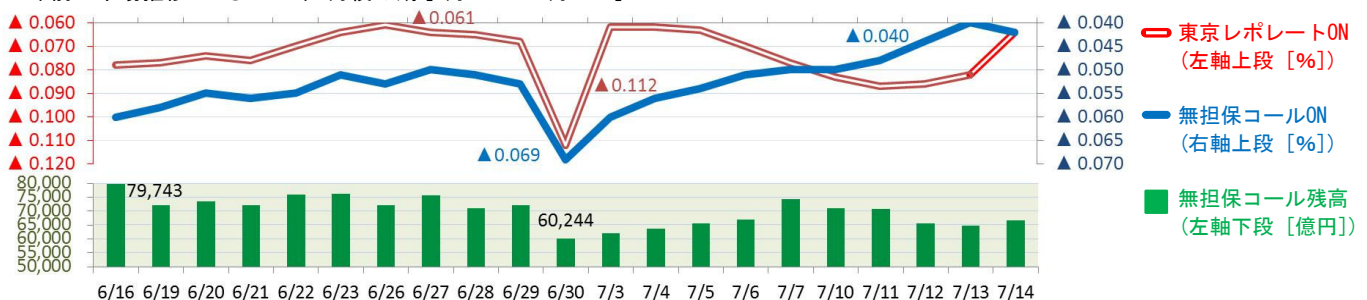
7月13日	3ヶ月	第770回
7月19日	1年	第771回
7月20日	3ヶ月	
7月27日	3ヶ月	
7月24日	40年	
7月26日	2年	
8月2日	10年	
8月7日	物価連動	

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	4 6 11 17 23 27	7月11日	3
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,000	4 6 11 13 19 25 27	7月11日	4
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,100	4 6 11 13 19 25	7月6日	3
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,900	2 6 13 19 25	7月2日	1
25年超	500~1,500 程度	700	月2回程度	7月2日	1
物価連動債	250 程度	250	-	6月8日	-
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	-	-	-

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。