

短期市場の推移

[億円] [%]

	7月9日	7月10日	7月11日	7月12日
加重平均金利	▲0.071	▲0.071	▲0.068	▲0.064
東京レポレート(ON)	▲0.085	▲0.088	▲0.090	▲0.091
無コール残	77,684	80,428	82,935	87,184
ON	47,869	49,713	51,920	56,119
その他	29,815	30,715	31,015	31,065
有コール残	32,795	27,809	31,323	31,629

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。

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	▲0.065	▲0.092
T/N	-	-	0.000	▲0.100
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	▲0.020	▲0.051	▲0.109
2W	▲0.050	▲0.045	▲0.047	▲0.111
3W	-	-	-	▲0.117
1M	-	-	-	▲0.123
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.131
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

7月17日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
17:00	業態別の日銀当座 預金残高(6月)	-	22:15	(米)6月鉱工業生産 指数[前月比]	0.6%
	-			(米)7月のNAHB 住宅市場指数	
	-			(米)FRB議長の 上院議会証言	

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

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。積み最終日にはあったものの、来積み期にかかるON物になることからビッドサイドが慎重な動きになり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.065%となった。

O/N業態別出合レンジ

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.075	▲0.080 ~ ▲0.070	▲0.080 ~ ▲0.045

翌営業日のマーケット

新積み期となる週明けは、ビッドサイドが慎重な調達姿勢になり、軟調な地合を予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	7月13日		7月17日		7月18日
券	▲500		+800		+1,000
財政	+700		+4,700		+2,000
過不足	+200		+5,500		+3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入			+6,900		
共通担保(全店)			+2,400		
CP等買入	▲100		▲700		+2,000
社債等買入			▲100		
ETF買入		+600		+600	
国債補完供給	+500	▲300	+300		
当座預金増減	+900		+13,000		+5,000
当座預金残高	3,853,100		3,866,100		3,871,100
準備預金残高	3,391,700		主な需給要因		
積み終了先	3,391,700				
超過準備	3,391,600		国債償還(2年)		
非準備預金残高	461,400		国庫短期証券		
準備預金進捗率	100.0%		発行・償還(3M)		
平均	100.0%				
乖離率	0.0%				

7月13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	按分
国債買入(7/17~)						
5~10年	4,100	15,087	4,106	0.002	0.003	21.0
10~25年	1,900	6,355	1,906	0.002	0.002	89.2
25年~	700	2,966	702	▲0.001	0.001	65.0
国債補完供給(7/13~7/17)						
	36,450	271	271	▲0.600	▲0.600	
	20,000	32	32	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(7/17~7/30)						
	8,000	2,853	2,853			

マネタリーベース[億円]
7月12日時点 4,944,700

所要
来積み期の所要準備額 3,129,300
7月17日以降の残り所要
積数 593,100
平均 19,800

国庫短期証券入札予定

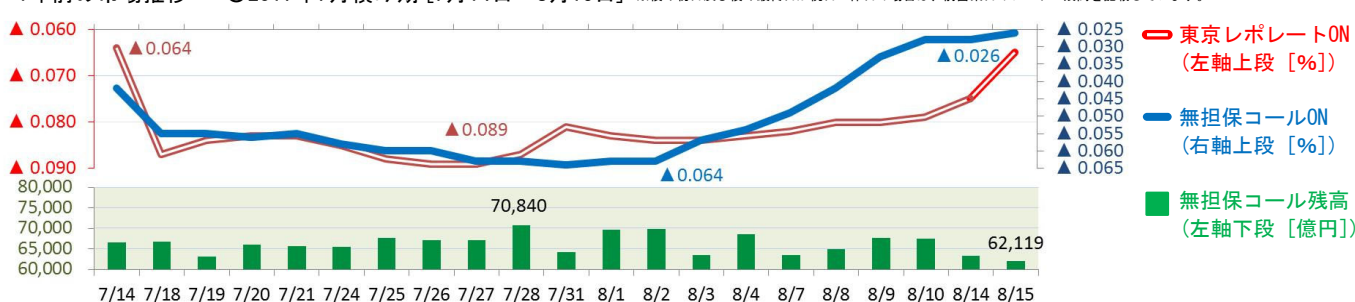
7月19日	1年	第771回
7月20日	3ヶ月	第772回
7月27日	3ヶ月	
8月3日	3ヶ月	
国債入札予定		
7月24日	40年	
7月26日	2年	
8月2日	10年	
8月7日	物価連動	

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

1年前の市場推移

○2017年7月積み期[7月14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。