

短期市場の推移

[億円][%]

	7月11日	7月12日	7月13日	7月17日
加重平均金利	▲0.068	▲0.064	▲0.065	▲0.072
東京レポレート(ON)	▲0.090	▲0.091	▲0.092	▲0.097
無コール残	82,935	87,184	74,977	74,508
ON	51,920	56,119	45,252	48,513
その他	31,015	31,065	29,725	25,995
有コール残	31,323	31,629	28,301	24,973

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19日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想	
8:50	6月貿易収支	5312億円	21:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分]	-
	-	-	21:30	(米)7月フィラデルフィア連銀製造業景況指数	20.0
	-	-	-	クオールズFRB理事の講演	-

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	▲0.120	0.001	▲0.072	▲0.133
T/N	-	-	0.000	▲0.128
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.040	▲0.045	▲0.127
2W	-	-	-	▲0.130
3W	-	-	-	▲0.130
1M	-	-	▲0.013	▲0.133
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.137
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▲0.08%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~▲0.055%で推移した。同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.072%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 ~ ▲0.055

翌営業日のマーケット

引き続き、ビッドサイドは慎重な調達姿勢のため、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18日	7月19日	7月19日	7月20日	7月20日	7月21日
券	+1,100	▲600	▲600	+0	+0	+0
財政	+2,900	▲4,400	▲4,400	▲7,000	▲7,000	▲7,000
過不足	+4,000	▲5,000	▲5,000	▲7,000	▲7,000	▲7,000
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
国庫短期証券買入		+5,000				
国債買入		+5,800				
CP等買入	▲100	+2,000	▲200			
社債等買入			▲100			
ETF買入		+1,000				
被災地金融機関支援				▲1,100	▲1,100	▲1,100
国債補充供給	+1,000	▲300	+300			
当座預金増減	+18,400	▲5,000	▲5,000	▲7,000	▲7,000	▲7,000
当座預金残高	3,886,400	3,881,400	3,881,400	3,874,400	3,874,400	3,874,400
準備預金残高	3,404,700					
積み終了先	3,364,300					
超過準備	3,341,900					
非準備預金残高	481,700					
準備預金進捗率	97.9%					
平均	9.7%					
乖離率	88.2%					

7月18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
国債補充供給(7/18~7/19)	32,239	272	272	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]

7月17日時点 4,960,300

所要

今積期の所要準備額 3,129,300

7月19日以降の残り所要

積数 66,400
平均 2,400

国庫短期証券入札予定

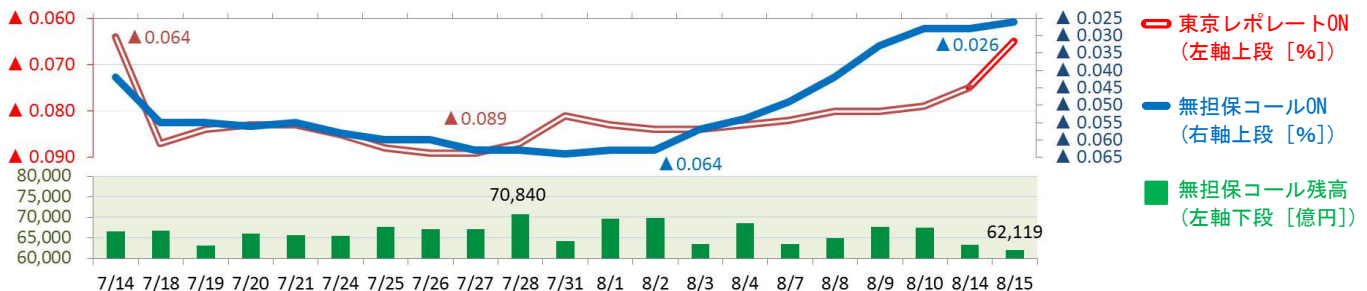
7月19日	1年	第771回
7月20日	3ヶ月	第772回
7月27日	3ヶ月	
8月3日	3ヶ月	
7月24日	40年	
7月26日	2年	
8月2日	10年	
8月7日	物価連動	

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			
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,000	4 6 11 17 23 27	7月17日	2
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,100	4 11 13 19 25 27	7月13日	3
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13日	2
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	7月17日	0
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。