

短期市場の推移

[億円][%]

	7月12日	7月13日	7月17日	7月18日
加重平均金利	▲0.064	▲0.065	▲0.072	▲0.072
東京レポレート(ON)	▲0.091	▲0.092	▲0.097	▲0.133
無コール残	87,184	74,977	74,508	70,220
ON	56,119	45,252	48,513	44,875
その他	31,065	29,725	25,995	25,345
有コール残	31,629	28,301	24,973	21,431

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20日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	6月消費者物価コア指数[前年比]	+0.8%	(米)セントルイス連銀総裁の講演		
13:30	全産業活動指数(5月)	0%	-	-	-
-	-	-	-	-	-

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

本日の市況

	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	▲0.072	▲0.129
T/N	0.000	0.001	0.001	▲0.141
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.055	▲0.020	▲0.049	▲0.137
2W	▲0.050	▲0.010	▲0.040	▲0.138
3W	-	-	-	▲0.139
1M	-	-	-	▲0.140
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.142
6M	-	-	-	▲0.149
1Y	-	-	-	▲0.158

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

無担保コールON物は▲0.08%の出合から始まり、その後は昨日に引き続き▲0.086~▲0.055%のレンジで推移した。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。本日通知された国債の買入では残存10年超25年以下及び25年超の買入れ額がそれぞれ100億円減額された。

O/N業態別出合レンジ

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.080	▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.086 ~ ▲0.055

翌営業日のマーケット

週末3日積みとなるものの、ビッドサイドの慎重な調達姿勢は変わらず、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19日	7月20日	7月20日	7月23日	7月23日
券	▲500	▲200	▲200	+0	
財政	+0	▲10,100	▲2,000	▲2,000	
過不足	▲500	▲10,300	▲2,000	▲2,000	
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			+6,800		
共通担保(全店)				▲1,300	
CP等買入	▲200		▲300		
社債等買入	▲100		▲100		
ETF買入			+100		
被災地金融機関支援			▲1,100	+1,100	
国債補充供給	+300	▲400	+400		
当座預金増減	▲900	▲3,400	▲3,300		
当座預金残高	3,885,500	3,882,100	3,878,800		
準備預金残高	3,401,700	主な需給要因			
積み終了先	3,378,300				
超過準備	3,373,800	国庫短期証券			
非準備預金残高	483,800	発行・償還(1Y)			
準備預金進捗率	98.8%	国庫短期証券			
平均	12.9%	発行・償還(3M)			
乖離率	85.9%	国債償還(変動15年)			

7月19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
国債買入(7/20~)						
5~10年	4,100	9,805	4,109	▲0.003	▲0.002	29.4
10~25年	1,800	5,309	1,804	▲0.002	0.000	38.3
25年~	600	2,526	603	0.001	0.001	99.3
社債等買入(7/25~)	1,000	2,229	1,001	▲0.149	▲0.119	96.1
国債補充供給(7/19~7/20)						
62,287	339	339	▲0.600	▲0.600		
3,097	73	73	▲0.600	▲0.600		

マナタリーベース [億円]
7月18日時点 4,977,600

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,129,300
7月20日以降の残り所要積数 38,500
平均 1,400

国庫短期証券入札予定

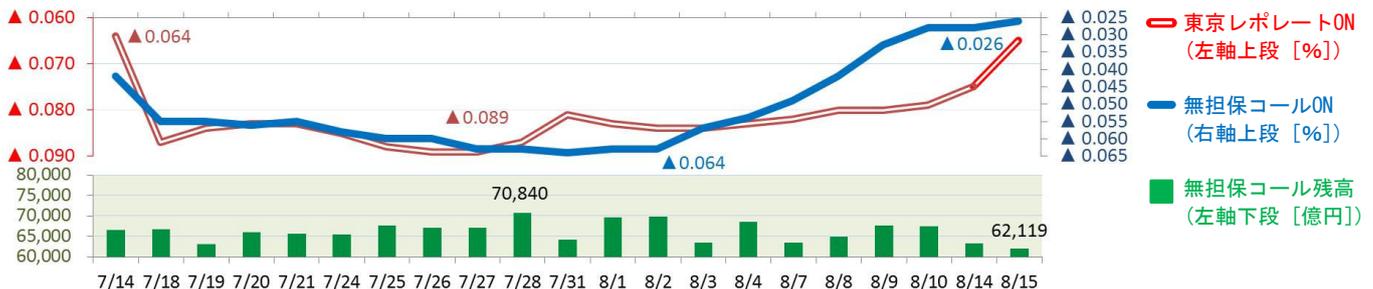
今月の国債買入オペ予定

7月20日	3ヶ月	第7/2回
7月27日	3ヶ月	
8月3日	3ヶ月	
8月9日	6ヶ月	
7月24日	40年	
7月26日	2年	
8月2日	10年	
8月7日	物価運動	

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
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,100	4 11 13 19 25	25 27	7月19日
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800	2 6 13 19	25	7月19日
25年超	500~1,500 程度	600			
物価運動債	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。