

短期市場の推移

[億円] [%]

	7月18日	7月19日	7月20日	7月23日
加重平均金利	▲0.072	▲0.072	▲0.072	▲0.068
東京レポレート(ON)	▲0.133	▲0.129	▲0.101	▲0.101
無コール残	70,220	70,788	71,734	65,759
ON	44,875	44,383	44,659	38,214
その他	25,345	26,405	27,075	27,545
有コール残	21,431	21,898	28,596	24,005

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25日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	預金種別店頭表示金利の平均年利率等	-	17:00	(独)7月IFO企業景況感指数	101.6
-	-	-	20:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]	-
-	-	-	23:00	(米)6月新築住宅販売件数	67.0

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

[%]

	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	▲0.070	▲0.137
T/N	-	-	0.000	▲0.169
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	0.001	▲0.049	▲0.155
2W	-	-	▲0.030	▲0.150
3W	-	-	▲0.010	▲0.146
1M	-	-	-	▲0.146
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.141
6M	-	-	-	▲0.148
1Y	-	-	-	▲0.155

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 outage から始まった。その後は主に▲0.086~▲0.05%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.070%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、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24日	7月25日	7月25日	7月26日	7月26日	7月26日
券	▲600	+200	▲1,000	▲1,000		
財政	▲5,200	+4,400	+2,000	+2,000		
過不足	▲5,800	+4,600	+1,000	+1,000		
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		+10,000				
国債買入		+6,000				
CP等買入	▲100		▲100			
社債等買入	▲100		▲200	+1,000		
国債補完供給	+500	▲700	+700			
当座預金増減		+9,800	+6,000	+1,000		
当座預金残高	3,886,500	3,892,500	3,893,500			
準備預金残高	3,398,100	主な需給要因				
積み終了先	3,396,300					
超過準備	3,396,300					
非準預先残高	488,400	国債発行(40年)				
準備預金進捗率	99.7%					
平均	29.0%					
乖離率	70.6%					

7月24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
米ドル資金供給(7/26~8/2)	0	0	2,420	2,420		
国債補完供給(7/24~7/25)	11,039	653	653	▲0.600	▲0.601	
	203	40	40	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]
7月23日時点 4,967,900

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,129,300
7月25日以降の残り所要積数 10,600
平均 500

国庫短期証券入札予定

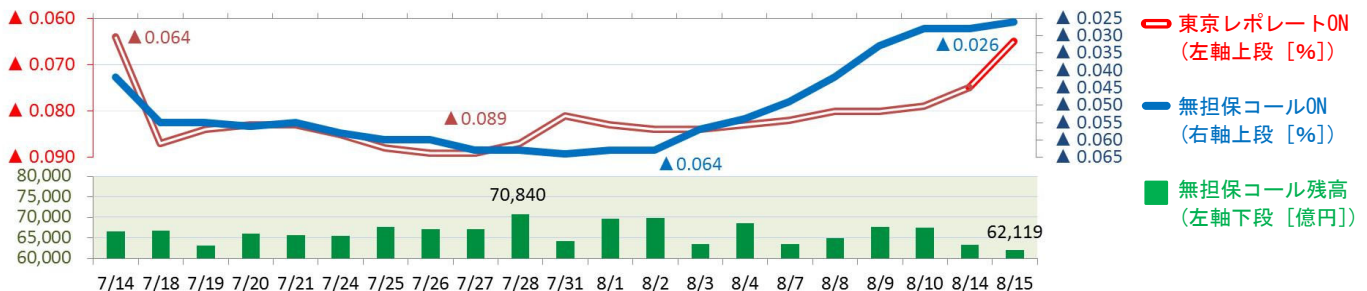
7月27日	3ヶ月	第7/3回
8月3日	3ヶ月	
8月9日	6ヶ月	
8月10日	3ヶ月	
国債入札予定		
7月26日	2年	
8月2日	10年	
8月7日	物価運動	
8月9日	30年	

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23日	0
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23日	1
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,100	4 11 13 19 25	27 7月19日	2
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	500~1,500 程度	600	2 6 13 19 25	7月19日	1
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。