

短期市場の推移

[億円] [%]

	7月23日	7月24日	7月25日	7月26日
加重平均金利	▲0.068	▲0.070	▲0.069	▲0.070
東京レポレート(ON)	▲0.101	▲0.137	▲0.161	▲0.117
無コール残	65,759	68,750	63,122	66,281
ON	38,214	40,495	34,627	37,886
その他	27,545	28,255	28,495	28,395
有コール残	24,005	19,040	15,914	14,309

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30日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 製造業部門別投入・産出物価指数(6月)	-	21:00 (独)7月消費者物価指数[前年比]	-
金融政策決定会合(1日目)	-	-	-
-	-	-	-

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	▲0.071	▲0.129
T/N	-	-	0.000	▲0.166
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	0.001	▲0.051	▲0.169
2W	▲0.040	▲0.005	▲0.032	▲0.159
3W	▲0.010	0.000	▲0.002	▲0.150
1M	-	-	-	▲0.147
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.144
6M	-	-	-	▲0.150
1Y	-	-	-	▲0.159

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▲0.080%の出合から始まった。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▲0.001%の▲0.071%となった。日銀は、残存期間5年超10年以下を対象に、指値オペ(固定利回格差+0.015%)を通知し、940億円応札があり、全額落札された。

O/N業態別出合レンジ

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.085 ~ ▲0.085	▲0.086 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

本日と同様にビッドサイドの調達姿勢は慎重であり、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27日	7月30日	7月31日
券	▲800	+200	▲1,000
財政	+800	+1,900	+21,100
過不足	+0	+2,100	+20,100
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+10,600
共通担保(全店)		▲2,900	+2,900
CP等買入	▲200	▲200	
国債補完供給	+900	▲300	+300
当座預金増減	+400	+12,500	+22,100
当座預金残高	3,897,900	3,910,400	3,932,500
準備預金残高	3,411,200	主な需給要因	
積み終了先	3,410,400	国庫短期証券	
超過準備	3,410,400	発行・償還(3M)	
非準備預金残高	486,700	財投機関向け貸し付け	
準備預金進捗率	99.8%		
平均	45.2%		
乖離率	54.7%		

7月27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(7/30~)						
1~3年	2,500	8,399	2,504	0.008	0.009	75.4
3~5年	3,000	5,786	3,002	0.005	0.007	98.4
5~10年	4,100	13,316	4,103	0.013	0.016	16.1
国債補完供給(7/27~7/30)	30,298	272	272	▲0.600	▲0.611	
共通担保(全店)(7/30~8/13)	8,000	2,554	2,554			
国債買入(固定利回り方式)(7/30~)						
5~10年		940	940			

マナタリーベース [億円]
7月26日時点 4,990,600

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,129,300
7月30日以降の残り所要積数 4,800
平均 300

国庫短期証券入札予定

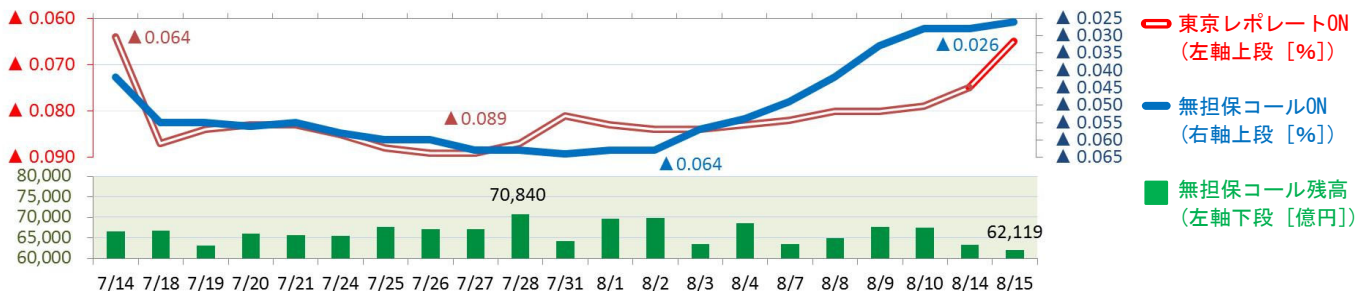
8月3日	3ヶ月	第7/4回
8月9日	6ヶ月	
8月10日	3ヶ月	
8月16日	1年	
国債入札予定		
8月2日	10年	
8月7日	物価運動	
8月9日	30年	
8月16日	5年	

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		7月27日	0
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,000	4 6 11 17 23 27	7月27日	0
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,100	4 11 13 19 25 27	7月27日	0
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800		7月25日	0
25年超	500~1,500 程度	600	2 6 13 19 25	7月17日	0
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。