

短期市場の推移

	7月30日	7月31日	8月1日	8月2日
加重平均金利	▲0.068	▲0.065	▲0.071	▲0.072
東京レポレート(ON)	▲0.113	▲0.201	▲0.101	▲0.103
無コール残	63,396	53,458	65,515	76,216
ON	36,071	28,453	37,560	47,361
その他	27,325	25,005	27,955	28,855
有コール残	12,282	9,191	22,153	22,423

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。

8月6日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
	特になし		特になし	
	-		-	
	-		-	

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	▲0.098
T/N	▲0.020	0.000	▲0.011	▲0.100
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.055	0.001	▲0.042	▲0.104
2W	-	-	-	▲0.109
3W	-	-	0.000	▲0.113
1M	-	-	-	▲0.119
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.130
6M	-	-	-	▲0.147
1Y	-	-	-	▲0.154

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▲0.085%の出合から始まった。その後は主に▲0.086~▲0.050%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。

O/N業態別出合レンジ

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

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの慎重な調達姿勢は週明けも継続し、本日と横ばいの▲0.086~▲0.050%の水準で取引されると予想する。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	8月3日	8月6日	8月7日
券	▲300	+900	+0
財政	▲23,700	+100	+2,000
過不足	▲24,000	+1,000	+2,000
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
国債買入	+4,100	+6,400	
共通担保(全店)		▲1,300	+1,300
CP等買入	▲100	▲200	
社債等買入		▲100	
国債補完供給	+10,800 ▲2,500	+2,500	
当座預金増減	▲11,700	+9,600	+2,000
当座預金残高	3,837,600	3,847,200	3,849,200
準備預金残高	3,362,000	主な需給要因	
積み終了先	3,361,800	国庫短期証券	
超過準備	3,361,800	発行・償還	
非準備先残高	475,600	(3M)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	67.7%		
乖離率	32.2%		

8月3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(8/6~)						
5~10年	4,000	10,883	4,004	▲0.008	▲0.005	89.0
10~25年	1,800	3,708	1,801	0.009	0.014	30.0
25年~	600	1,856	604	0.020	0.021	67.4
国債補完供給(8/3~8/6)						
	82,191	2,444	2,444	▲0.600	▲0.600	
	639	32	32	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(8/6~8/20)						
	8,000	1,251	1,251			

マナタリーベース [億円]
8月2日時点 4,943,800

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,127,300
8月6日以降の残り所要積数 1,500
平均 200

国庫短期証券入札予定

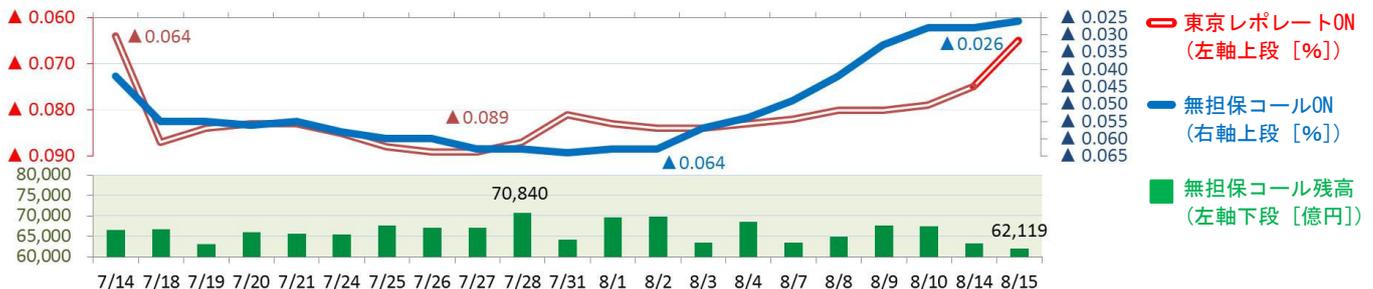
8月9日	6ヶ月	第775回
8月10日	3ヶ月	第776回
8月16日	1年	
8月17日	3ヶ月	
国債入札予定		
8月7日	物価連動	
8月9日	30年	
8月16日	5年	
8月21日	20年	

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	8月1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	8 10 17 24 31	8月1日	5
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,000	8 15 22 24 31	8月3日	5
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	500~1,500 程度	600	10 15 22 29	8月3日	4
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	7月17日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	6月8日	1

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。