

短期市場の推移

[億円] [%]

	7月26日	7月29日	7月30日	7月31日
加重平均金利	▲0.073	▲0.072	▲0.071	▲0.071
東京レポレート(ON)	▲0.080	▲0.079	▲0.077	▲0.074
無コール残	90,685	87,534	81,160	82,674
ON	57,120	51,629	47,705	50,064
その他	33,565	35,905	33,455	32,610
有コール残	21,216	22,811	21,149	22,309

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。

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	▲0.085	0.001	▲0.070	▲0.065
T/N	-	-	-	▲0.068
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.045	▲0.071
2W	▲0.040	0.000	▲0.016	▲0.076
3W	-	-	0.000	▲0.084
1M	▲0.045	▲0.020	▲0.024	▲0.092
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.113
6M	-	-	-	▲0.149
1Y	-	-	-	▲0.160

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

8月2日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	政策委員会・金融政策決定会合議事要旨(6月19・20日分)	-	21:30	(米)6月貿易収支 -540億米ドル
10:00	営業毎旬報告(7月31日現在)	-	21:30	(米)7月非農業部門雇用者数 16.0万人
-	【記者会見】両宮副総裁(8月1日)	-	21:30	(米)7月失業率 3.6%

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は、▲0.075%の合出から始まった。その後は主に▲0.080%~▲0.065%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▲0.070%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.073	▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.080 ~ ▲0.055

翌営業日のマーケット

週末3日積となることで本日より調達ニーズが強くなり出合水準は上昇すると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報 8月1日	日銀予想 8月2日	当社需給予想 8月5日
券	▲400	▲100	▲300
財政	▲28,000	▲84,500	▲7,000
過不足	▲28,400	▲84,600	▲7,300
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+2,500		
国債買入	+12,700		
共通担保(全店)			▲2,400
CP等買入		▲100	
国債補完供給	+300 ▲100	+100	
当座預金増減	▲13,000	▲84,600	▲9,700
当座預金残高	4,046,500	3,961,900	3,952,200
準備預金残高	3,542,000	主な需給要因	
積み終了先	3,541,300	国債発行(10年) 税・保険揚げ	
超過準備	3,541,100		
非準備預金残高	504,500		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	54.8%		
乖離率	45.1%		

8月1日のオペ結果 [円][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	按分
国債補完供給(8/1~8/2)	56	56	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
7月31日時点 5,182,600	今積期の所要準備額 3,186,400
	8月2日以降の残り所要
	積数 3,000
	平均 200

国庫短期証券入札予定

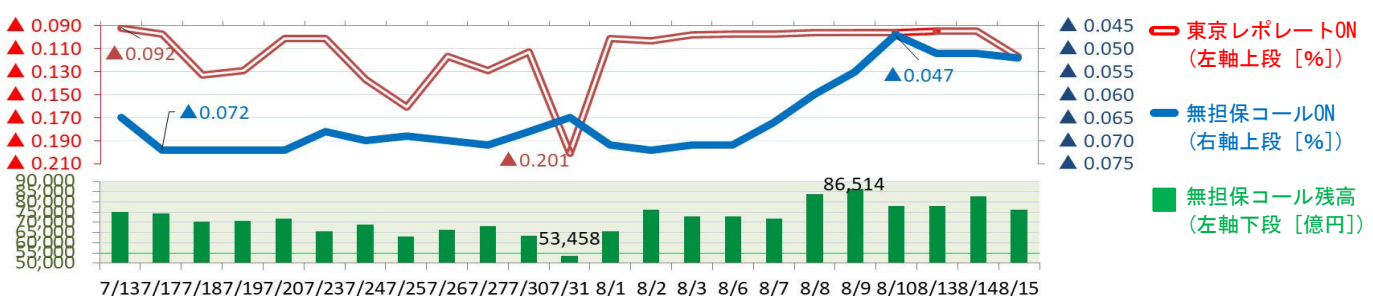
8月2日	3ヶ月	第848回
8月8日	6ヶ月	第849回
8月9日	3ヶ月	
8月16日	3ヶ月	
国債入札予定		
8月6日	30年	
8月8日	物価連動	
8月15日	5年	
8月20日	20年	

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	7月26日	2
1年超3年以下	2,500~5,000 程度	3,800	9 19 23 30	7月31日	4
3年超5年以下	2,500~5,000 程度	3,800	5 16 23 30	7月31日	4
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	2 9 26	7月26日	3
10年超25年以下	1,000~2,500 程度	1,800	月2回程度	7月22日	2
25年超	100~1,000 程度	400	月1回	6月14日	1
物価連動債	250 程度	250			
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000			

1年前の市場推移 ○2018年7月積み期 [7月13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。