

### 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	▲0.071	▲0.071	▲0.070	▲0.063
東京レポレート(ON)	▲0.077	▲0.074	▲0.065	▲0.062
無コール残	81,160	82,674	91,366	82,598
ON	47,705	50,064	58,326	50,098
その他	33,455	32,610	33,040	32,500
有コール残	21,149	22,309	22,224	20,102

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
14:00	景気動向指数速報(6月)	-	(米)セントルイス連銀総裁の講演	-
	-	-	(米)シカゴ連銀総裁の講演	-
	-	-	-	-

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	▲0.120	0.001	▲0.050	▲0.030
T/N	-	-	-	▲0.025
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.035	▲0.035
2W	-	-	-	▲0.043
3W	-	-	-	▲0.061
1M	-	-	-	▲0.076
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.104
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

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は、▲0.060%の合出から始まった。その後は大手行を中心にビッドサイドの調達意欲が強まり、主に▲0.060%~▲0.040%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+0.013%の▲0.050%と、大きく上昇した。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.050		▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.060 ~ ▲0.040

### 翌営業日のマーケット

大手行を中心に資金調達ニーズは強まり、出合いの水準は一層上昇と予想する。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月5日	8月6日	8月6日	8月7日	8月7日	8月7日
券		+600		+300		+0
財政		▲2,000		+800		▲7,000
過不足		▲1,400		+1,100		▲7,000
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		+3,200		+6,500		
共通担保(全店)	▲2,400	+2,300				
CP等買入	▲200					
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+100					
当座預金増減		+1,500		+7,600		▲7,000
当座預金残高		3,960,300		3,967,900		3,960,900
準備預金残高		3,467,300	主な需給要因			
積み終了先		3,467,100				
超過準備		3,467,100				
非準備先残高		493,000				国債発行(30年)
準備預金進捗率		99.9%				
平均		67.7%				
乖離率		32.2%				

### 8月5日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(8/6~)						
~1年	500	1,277	501	0.006	0.013	6.2
5~10年	4,800	12,324	4,808	▲0.029	▲0.026	69.2
変動利付	1,000	2,887	1,003	▲0.190	▲0.202	47.8
国債補完供給(8/5~8/6)						
		0	0			
		0	0			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
8月2日時点 5,082,300	今積期の所要準備額 3,186,400
	8月6日以降の残り所要積数 1,700
	平均 200

### 国庫短期証券入札予定

8月8日	6ヶ月	第849回
8月9日	3ヶ月	第850回
8月16日	3ヶ月	
8月19日	1年	
8月6日	30年	
8月8日	物価運動	
8月15日	5年	
8月20日	20年	

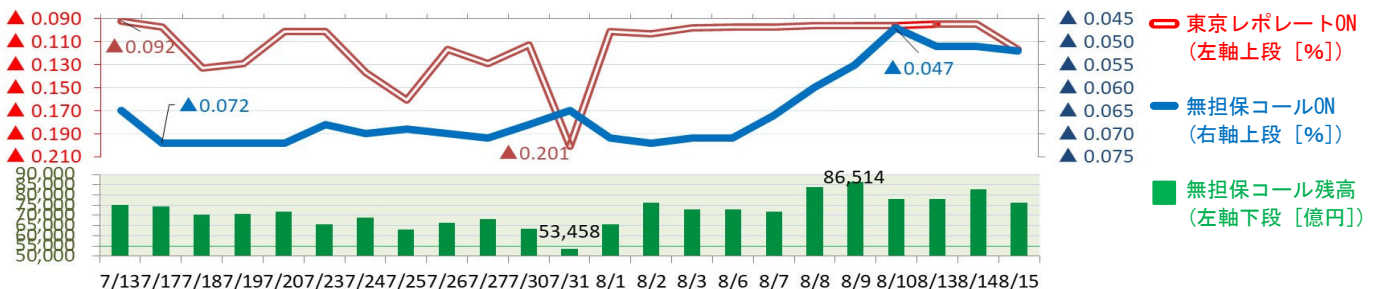
### 今月の国債買入オペ予定

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	8月5日	1
1年超3年以下	2,500~5,000 程度	3,800			
3年超5年以下	2,500~5,000 程度	3,800	9 19 23 30	7月31日	4
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	5 16 23 30	8月5日	3
10年超25年以下	1,000~2,500 程度	1,800			
25年超	100~1,000 程度	400	2 9 26	8月2日	2
物価運動債	250 程度	250	月2回程度	8月2日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	月1回	8月5日	0

### 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。