

### 短期市場の推移

	7月31日	8月1日	8月2日	8月5日
加重平均金利	▲0.071	▲0.070	▲0.063	▲0.050
東京レポレート(ON)	▲0.074	▲0.065	▲0.062	▲0.030
無コール残	82,674	91,366	82,598	79,654
ON	50,064	58,326	50,098	47,084
その他	32,610	33,040	32,500	32,570
有コール残	22,309	22,224	20,102	19,677

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7日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
8:50	金融政策決定会合における 主な意見(7月29~30日分)	-	20:00	(米)MBA住宅ローン 申請指数[前週比]
14:00頃	消費活動指数	-	-	-
15:00	コール市場残高(7月)	-	-	-

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	▲0.065	0.001	▲0.031	▲0.038
T/N	-	-	-	▲0.039
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	▲0.015	▲0.018	▲0.042
2W	▲0.030	0.000	▲0.013	▲0.049
3W	-	-	0.000	▲0.065
1M	-	-	-	▲0.080
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.060	▲0.105
6M	-	-	-	▲0.150
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、▲0.035%の出合から始まった。昨日に引き続き、大手行を中心にビッドサイドの調達意欲が強く、主に▲0.040%~▲0.030%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は▲0.031%(前営業日対比+0.019%)と上昇し、本年5月15日以来(▲0.025%)の高水準となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.030	▲0.035 ~ ▲0.030	▲0.040 ~ ▲0.030

### 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続き、横ばい圏での取引となろう。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月6日	8月7日	8月7日	8月8日	8月8日	8月8日
券	+400	▲200	▲200	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲1,600	▲5,400	▲5,400	▲2,000	▲2,000	▲2,000
過不足	▲1,200	▲5,600	▲5,600	▲3,000	▲3,000	▲3,000
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				+5,000		
国債買入		+6,500				
CP等買入			▲100			
ETF買入				+100		
国債補完供給		▲100	+100			
当座預金増減	+5,200	▲500	▲500	▲3,000	▲3,000	▲3,000
当座預金残高	3,965,500	3,965,000	3,965,000	3,962,000	3,962,000	3,962,000
準備預金残高	3,458,700	主な需給要因				
積み終了先	3,458,500					
超過準備	3,458,500					
非準備預金残高	506,800	国債発行(30年)				
準備預金進捗率	99.9%					
平均	71.0%					
乖離率	28.9%					

### 8月6日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国庫短期証券買入(8/7~)	5,000	14,752	5,001	0.008	0.010	87.3
米ドル資金供給(8/8~8/15)			1	2.620	2.620	
CP等買入(8/9~)	2,500	6,622	2,480	▲0.001	▲0.001	76.2
国債補完供給(8/6~8/7)	50	50	▲0.250	▲0.250		

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
8月5日時点 5,083,100	今積期の所要準備額 3,186,400
	8月7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

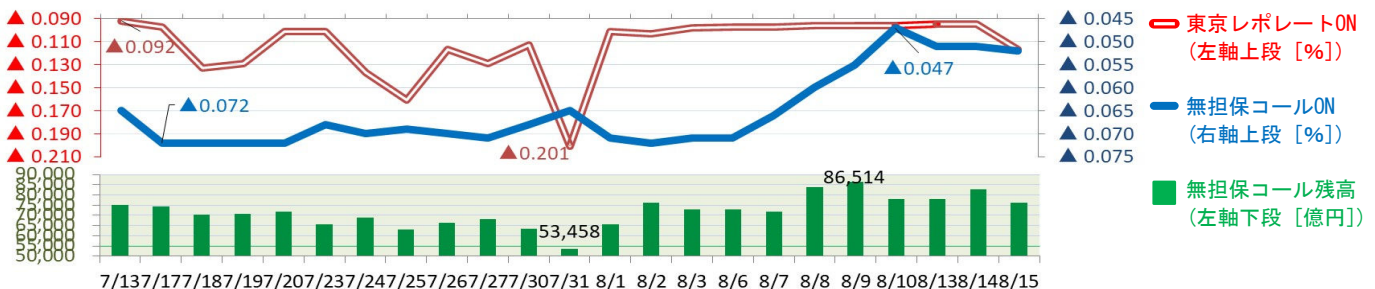
8月8日	6ヶ月	第849回
8月9日	3ヶ月	第850回
8月16日	3ヶ月	
8月19日	1年	
国債入札予定		
8月8日	物価連動	
8月15日	5年	
8月20日	20年	
8月29日	2年	

### 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
物価連動債	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。