

短期市場の推移

	8月2日	8月5日	8月6日	8月7日
加重平均金利	▲0.063	▲0.050	▲0.031	▲0.032
東京レポレート(ON)	▲0.062	▲0.030	▲0.038	▲0.039
無コール残	82,598	79,654	79,373	90,552
ON	50,098	47,084	46,113	57,712
その他	32,500	32,570	33,260	32,840
有コール残	20,102	19,677	18,273	19,580

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9日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
8:50	国内総生産(GDP)速報値[前期比年率]	+0.6%	17:30 (英)4-6月期国内総生産(GDP)速報値[前年比]	-
8:50	マネーストック(7月)	-	17:30 (英)6月鉱工業生産指数[前月比]	-
			21:30 (米)7月生産者物価コア指数[前年比]	2.3%

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	▲0.070	0.001	▲0.033	▲0.044
T/N	-	-	-	▲0.073
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	0.000	▲0.024	▲0.072
2W	▲0.025	▲0.020	▲0.022	▲0.082
3W	-	-	-	▲0.088
1M	-	-	-	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.106
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	0.100	▲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、▲0.030%の出合から始まった。昨日と同様にビッドサイドの調達意欲は堅調で、主に▲0.040%~▲0.025%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は▲0.033%(前営業日対比▲0.001%)になった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.045 ~ ▲0.035	▲0.030 ~ ▲0.025	▲0.040 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

週末3日積みとなるが堅調な資金調達ニーズは続き、本日と横ばいの地合を予想。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	8月8日	8月9日	8月13日
券	▲1,000	▲1,000	+1,000
財政	+3,600	▲6,500	▲4,000
過不足	+2,600	▲7,500	▲3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)			▲700
CP等買入	▲200	▲100	+2,500
ETF買入	+200		
国債補完供給	▲400	+400	
当座預金増減	+2,200	▲4,700	▲3,700
当座預金残高	3,966,800	3,962,100	3,958,400
準備預金残高	3,455,300	主な需給要因	
積み終了先	3,455,100	国債発行(物価連動10年)	
超過準備	3,455,100	国庫短期証券発行・償還(3M・6M)	
非準備先残高	511,500		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	77.4%		
乖離率	22.5%		

8月8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
国債補完供給(8/8~8/9)	331	331	▲0.250	▲0.250		

マナタリーベース [億円]
 8月7日時点 5,087,100

所要	所要準備額
今積期の所要準備額	3,187,400
8月9日以降の残り所要積数	1,000
平均	100

国庫短期証券入札予定

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23日	3ヶ月	
国債入札予定		
8月15日	5年	
8月20日	20年	
8月29日	2年	
9月3日	10年	

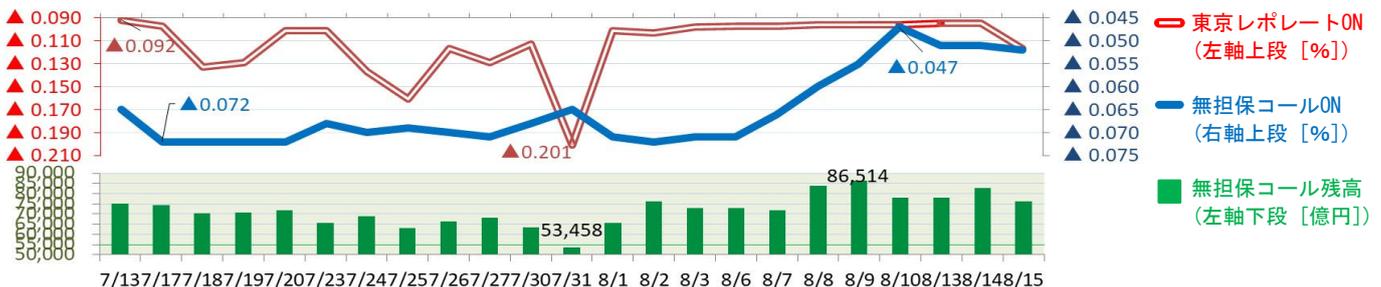
今月の国債買入オペ予定

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。