

短期市場の推移

[億円] [%]

	8月9日	8月13日	8月14日	8月15日
加重平均金利	▲0.029	▲0.025	▲0.019	▲0.020
東京レポレート(ON)	▲0.078	▲0.101	▲0.102	▲0.090
無コール残	86,746	86,286	93,429	93,833
ON	56,856	56,886	63,899	64,253
その他	29,890	29,400	29,530	29,580
有コール残	17,986	17,820	19,331	17,786

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	▲0.080	0.001	▲0.057	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.089
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	0.000	▲0.043	▲0.092
2W	▲0.047	▲0.025	▲0.038	▲0.094
3W	-	-	-	▲0.097
1M	-	-	▲0.035	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.118
6M	-	-	-	▲0.152
1Y	-	-	-	▲0.162

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19日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	7月貿易収支	-1900億円	17:00	(欧)6月経常収支
14:00頃	実質輸出入の動向	-	-	-
	-	-	-	-

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

積み初日となる本日の無担保コールON物は、▲0.06%の出合から始まりその後は、主に▲0.07%~▲0.06%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は▲0.057%(前営業日対比▲0.037%)となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.055	▲0.065 ~ ▲0.010	▲0.070 ~ ▲0.040

翌営業日のマーケット

調達サイドの動向に変化はなく、出合の水準は横ばいと予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	8月16日	8月19日	8月20日
券	+800	+900	+1,000
財政	▲21,000	▲2,400	▲10,000
過不足	▲20,200	▲1,500	▲9,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		▲4,700	
共通担保(全店)		▲2,300	
CP等買入	▲200	▲200	
社債等買入	▲100		
ETF買入	+700	+100	
当座預金増減	▲19,800	+3,100	▲9,000
当座預金残高	4,031,100	4,034,200	4,025,200
準備預金残高	3,489,400	主な需給要因	
積み終了先	3,444,000		
超過準備	2,449,800		
非準備先残高	541,700		
準備預金進捗率	98.1%	国庫短期証券発行・償還(3M)	国庫短期証券発行・償還(1Y)
平均	9.7%		
乖離率	88.4%		

8月16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	按分
国債買入(8/19~)						
5~10年	4,500	13,485	4,501	▲0.007	▲0.006	17.0
国債補充完給(8/16~8/19)						
		4	4	▲0.350	▲0.350	
共通担保(全店)(8/19~9/2)						
	15,000	2,307	2,307			

マネタリーベース [億円]
8月15日時点 5,175,100

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,179,400
8月19日以降の残リ所要
積数 60,700
平均 2,200

国庫短期証券入札予定

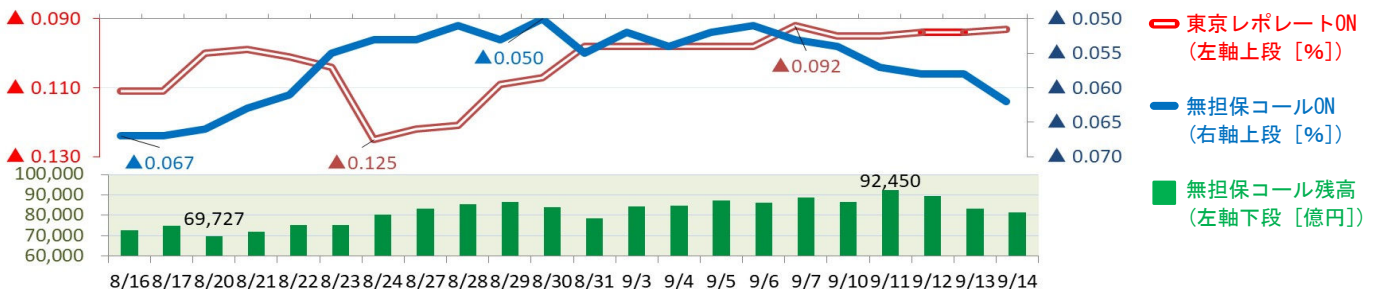
8月19日	1年	第852回
8月23日	3ヶ月	第853回
8月30日	3ヶ月	
9月6日	3ヶ月	
国債入札予定		
8月20日	20年	
8月29日	2年	
9月3日	10年	
9月5日	30年	

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	4,000		8月9日	3
3年超5年以下	2,500~5,000 程度	3,600	9 19 23 30	8月16日	2
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,500	5 16 23 30	8月9日	1
10年超25年以下	1,000~2,500 程度	1,600	2 9 26	8月2日	1
25年超	100~1,000 程度	400		8月5日	#VALUE!
物価連動債	250 程度	250	月2回程度		
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	月1回		

1年前の市場推移 ○2018年8月積み期 [8月16日~9月14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。