

短期市場の推移

	7月25日	7月26日	7月27日	7月30日
加重平均金利	▲0.069	▲0.070	▲0.071	▲0.068
東京レポレート(ON)	▲0.161	▲0.117	▲0.129	▲0.113
無コール残	63,122	66,281	68,254	63,396
ON	34,627	37,886	40,829	36,071
その他	28,495	28,395	27,425	27,325
有コール残	15,914	14,309	13,848	12,282

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1日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
13:00	日銀当座預金増減要因と金融調節(7月実績)	-	23:00 (米)7月ISM製造業景況指数	59.2
14:00	経済・物価情勢の展望(7月、全文)	-	(米)FOMC(2日目)	-
-	【記者会見要旨】黒田総裁(7月31日)	-	(英)金融政策決定委員会(1日目)	-

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	▲0.086	0.001	▲0.065	▲0.201
T/N	-	-	0.000	▲0.180
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	▲0.020	▲0.028	▲0.157
2W	▲0.065	▲0.055	▲0.064	▲0.154
3W	-	-	▲0.010	▲0.145
1M	-	-	-	▲0.143
2M	-	-	▲0.040	-
3M	-	-	-	▲0.145
6M	-	-	-	▲0.150
1Y	-	-	-	▲0.159

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

無担保コールON物は▲0.085%の出合から始まった。その後は主に▲0.086~▲0.050%の水準で取引された。日銀は金融政策決定会合において、「強力な金融緩和継続のための枠組み強化」を決定し、8月積み期間のマクロ加算残高の算出に用いる基準比率を、30.5%から33.0%に変更した。

O/N業態別出合レンジ

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	▲0.085 ~ ▲0.085	▲0.086 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの慎重な調達姿勢は継続し、軟調な地合となると予想する。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	7月31日	8月1日	8月2日
券	▲100	+500	+0
財政	+19,800	▲28,100	▲67,000
過不足	+19,700	▲27,600	▲67,000
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		+16,000	
CP等買入	▲1,400	+2,000	
国債補完供給	+600	▲13,800	+13,800
当座預金増減	+25,600	▲13,800	▲67,000
当座預金残高	3,937,100	3,923,300	3,856,300
準備預金残高	3,444,100	主な需給要因	
積み終了先	3,443,200	国債発行(2年)	法人税消費税保険揚げ
超過準備	3,443,200		
非準備預金残高	493,000		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	51.6%		
乖離率	48.3%		

7月31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
米ドル資金供給(8/2~8/9)		0	0	2,420	2,420	
国債補完供給(7/31~8/1)	78,818	14,246	13,589	▲0.600	▲4.761	
	10,000	8	8	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]
7月30日時点 5,005,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,127,300
8月1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

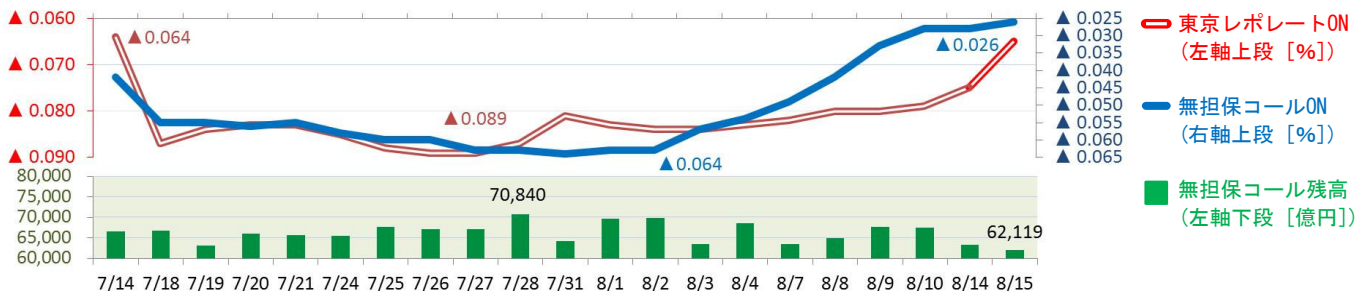
8月3日	3ヶ月	第7/74回
8月9日	6ヶ月	
8月10日	3ヶ月	
8月16日	1年	
国債入札予定		
8月2日	10年	
8月7日	物価連動	
8月9日	30年	
8月16日	5年	

来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23日	2
1年超3年以下	2,000~3,000 程度	2,500			
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,000	1 8 10 17 24 31	7月27日	6
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,100	3 8 15 22 24 31	7月27日	6
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	500~1,500 程度	600	3 10 15 22 29	7月25日	5
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	7月17日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	6月8日	1

1年前の市場推移

○2017年7月積み期 [7月14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。