

平成30年8月1日(水)

短期市場の推移

[億円] [%]

	7月26日	7月27日	7月30日	7月31日
加重平均金利	▲0.070	▲0.071	▲0.068	▲0.065
東京レポレート(ON)	▲0.117	▲0.129	▲0.113	▲0.201
無コール残	66,281	68,254	63,396	53,458
ON	37,886	40,829	36,071	28,453
その他	28,395	27,425	27,325	25,005
有コール残	14,309	13,848	12,282	9,191

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2日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネタリーベース (7月)	-	3:00 (米)FOMC声明・政策金利発表	2.00%
10:00	営業毎旬報告 (7月31日現在)	-	(米)新規失業保険申請件数[前週分]	
10:30	【挨拶】雨宮副総裁 (京都)	-	(欧)6月生産者物価指数[前年比]	-

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	▲0.071	▲0.101
T/N	-	-	0.000	▲0.106
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	0.001	▲0.031	▲0.107
2W	▲0.058	▲0.040	▲0.051	▲0.108
3W	-	-	-	▲0.116
1M	▲0.040	0.030	▲0.019	▲0.125
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.134
6M	-	-	-	▲0.148
1Y	-	-	-	▲0.155

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%の出合から始まり、その後は主に▲0.086~▲0.055%の水準で取引された。前営業日より▲0.08%台の出合が増加したため、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.006%の▲0.071%となった。

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 ~ ▲0.055

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、前営業日と横ばいの▲0.086~▲0.055%の水準で取引されると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報 8月1日	日銀予想 8月2日	当社需給予想 8月3日
券	+400	▲1,000	+0
財政	▲30,600	▲65,500	▲20,000
過不足	▲30,200	▲66,500	▲20,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	スタート	+6,100	スタート
国債補充供給	+13,800	▲11,200	+11,200
当座預金増減	▲27,600	▲49,200	▲20,000
当座預金残高	3,909,500	3,860,300	3,840,300
準備預金残高	3,417,100	主な需給要因	
積み終了先	3,416,700	法人税・消費税・保険揚げ	
超過準備	3,416,400		
非準備先残高	492,400		
準備預金進捗率	99.9%	国債発行 (10年)	
平均	54.8%		
乖離率	45.1%		

8月1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(8/2~)						
~1年	500	3,154	502	0.026	0.032	30.4
1~3年	2,500	9,450	2,508	0.022	0.023	64.9
3~5年	3,000	9,046	3,003	0.028	0.031	66.2
国債補充供給(8/1~8/2)						
	72,883	11,033	11,033	▲0.600	▲1.438	

マネタリーベース [億円]
7月31日時点 5,030,900

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,127,300
8月2日以降の残り所要
積数 2,400
平均 200

国庫短期証券入札予定

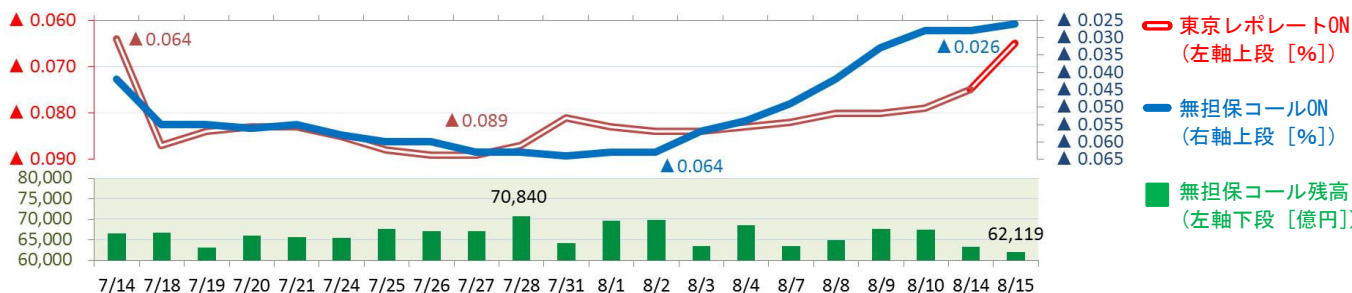
8月3日	3ヶ月	第774回
8月9日	6ヶ月	
8月10日	3ヶ月	
8月16日	1年	
国債入札予定		
8月2日	10年	
8月7日	物価運動	
8月9日	30年	
8月16日	5年	

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		
1年超3年以下	2,000~3,000 程度	2,500	8	10	17
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,000	8	10	17
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,100	3	8	15
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800	3	10	15
25年超	500~1,500 程度	600	3	10	15
物価運動債	250 程度	250	月2回程度		
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	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。

上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会