

### 短期市場の推移

	7月31日	8月1日	8月2日	8月3日
加重平均金利	▲0.065	▲0.071	▲0.072	▲0.071
東京レポレート(ON)	▲0.201	▲0.101	▲0.103	▲0.098
無コール残	53,458	65,515	76,216	72,826
ON	28,453	37,560	47,361	43,911
その他	25,005	27,955	28,855	28,915
有コール残	9,191	22,153	22,423	27,070

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)

日本	予想	海外	予想
8:50 マネタリーベースと日本銀行の取引(7月)	-	13:30 (豪)8月豪中銀(RBA)政策金利	1.5%
14:00頃 消費活動指数	-	15:00 (独)6月貿易収支	-
15:00 コール市場残高(7月)	-	15:00 (独)6月鉱工業生産指数[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	▲0.097
T/N	-	-	0.000	▲0.100
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.025	▲0.033	▲0.105
2W	-	-	▲0.010	▲0.107
3W	-	-	0.000	▲0.113
1M	-	-	-	▲0.119
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.130
6M	-	-	-	▲0.146
1Y	-	-	-	▲0.154

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▲0.08%の合出から始まった。その後は主に▲0.086~▲0.035%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比横ばいの▲0.071%となった。

### O/N業態別合出レンジ

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.085	▲0.085 ~ ▲0.080	▲0.086 ~ ▲0.035

### 翌営業日のマーケット

地銀業態を中心に調達サイドがやや厚くなると思われるが、合出レンジに大きな変化はなく、▲0.086~▲0.035%の水準で取引されるだろう。

### 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		+900		+200		+0
財政		+2,000		+200		▲4,000
過不足		+2,900		+400		▲4,000
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				+2,500		
国債買入		+6,400				
共通担保(全店)	▲1,300	+1,300				
CP等買入	▲200			▲100		
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+2,500	▲2,300	+2,300			
当座預金増減		+9,200		+5,100		▲4,000
当座預金残高		3,846,800		3,851,900		3,847,900
準備預金残高		3,366,100				
積み終了先		3,365,900				
超過準備		3,365,900				
非準備預金残高		480,700				
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 [%][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
国庫短期証券買入(8/7~)	2,500	10,681	2,500	0.000	0.002	56.0
国債補完供給(8/6~8/7)	114,480	2,237	2,237	▲0.600	▲0.600	
	9,935	30	30	▲0.600	▲0.600	

### マネタリーベース [億円]

8月3日時点 4,932,300

### 所要

今積期の所要準備額	所要
8月7日以降の残り所要	3,127,300
積数	1,300
平均	100

### 国庫短期証券入札予定

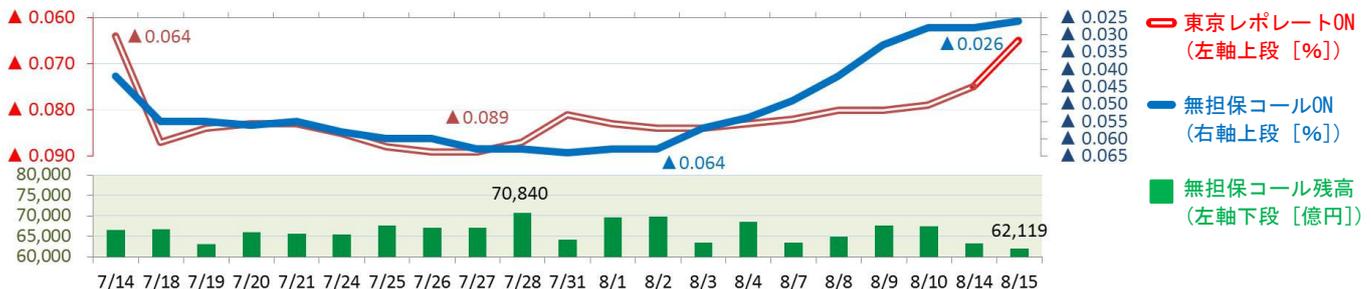
8月9日	6ヶ月	第775回
8月10日	3ヶ月	第776回
8月16日	1年	
8月17日	3ヶ月	

### 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1日	1
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	4,000	8	15	22
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800	8	15	22
25年超	500~1,500 程度	600	10	15	22
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。