

短期市場の推移

	8月1日	8月2日	8月3日	8月6日
加重平均金利	▲0.071	▲0.072	▲0.071	▲0.071
東京レポレート(ON)	▲0.101	▲0.103	▲0.098	▲0.097
無コール残	65,515	76,216	72,826	72,742
ON	37,560	47,361	43,911	43,677
その他	27,955	28,855	28,915	29,065
有コール残	22,153	22,423	27,070	26,818

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8日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	6月国際収支(経常収支)	12189億円	20:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]
8:50	金融政策決定会合における主な意見(7月30・31日分)	-	-	-
8:50	貸出・預金動向(7月)	-	-	-

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	▲0.066	▲0.097
T/N	-	-	0.000	▲0.104
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.030	▲0.037	▲0.107
2W	-	-	-	▲0.108
3W	-	-	0.000	▲0.113
1M	-	-	-	▲0.119
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.131
6M	-	-	-	▲0.147
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%の都合から始まった。その後は主に▲0.075~▲0.030%の水準で取引され、昨日より堅調な地合いになった。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比+0.005%の▲0.066%となった。

O/N業態別適合レンジ

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.080	▲0.085 ~ ▲0.075	▲0.086 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

引続き調達意欲は強まると予想されるため、適合レンジも小幅上昇方向と思われる。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	8月7日	8月8日	8月9日
券	+200	+300	+0
財政	+2,900	▲4,200	▲2,000
過不足	+3,100	▲3,900	▲2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+2,500		
CP等買入	▲100	▲200	
国債補完供給	+2,300	+2,600	
当座預金増減	+5,200	▲1,500	▲2,000
当座預金残高	3,852,000	3,850,500	3,848,500
準備預金残高	3,383,400	主な需給要因	
積み終了先	3,383,300	10年物価連動 国債発行	
超過準備	3,383,300		
非準預先残高	468,600		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	74.2%		
乖離率	25.7%		

8月7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(8/9~8/16)		1	1	2,410	2,410	
CP等買入(8/10~)	2,000	6,216	1,965	▲0.001	▲0.001	43.6
国債補完供給(8/7~8/8)	63,303	2,540	2,540	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]
8月6日時点 4,940,600

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,136,200
8月8日以降の残り所要積数 1,200
平均 100

国庫短期証券入札予定

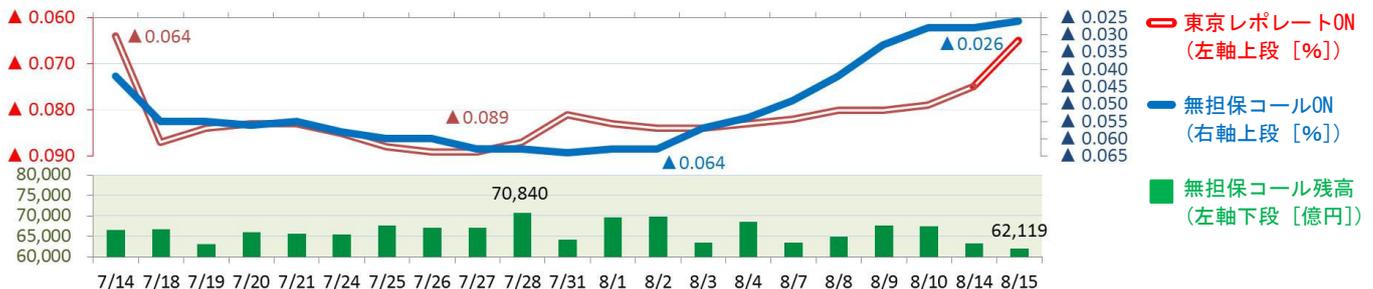
8月9日	6ヶ月	第775回
8月10日	3ヶ月	第776回
8月16日	1年	
8月17日	3ヶ月	
国債入札予定		
8月9日	30年	
8月16日	5年	
8月21日	20年	
8月30日	2年	

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1日	1
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	8/10 17 24 31	8月1日	5
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,000	8/15 22 24 31	8月3日	5
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800	10/15 22 29	8月3日	4
25年超	500~1,500 程度	600			
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。