

平成30年8月9日(木)

短期市場の推移

[億円] [%]

	8月3日	8月6日	8月7日	8月8日
加重平均金利	▲0.071	▲0.071	▲0.066	▲0.060
東京レポレート(ON)	▲0.098	▲0.097	▲0.097	▲0.096
無コール残	72,826	72,742	71,689	83,815
ON	43,911	43,677	44,274	55,520
その他	28,915	29,065	27,415	28,295
有コール残	27,070	26,818	23,751	24,985

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	▲0.055	▲0.096
T/N	-	-	0.000	▲0.106
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.029	▲0.030	▲0.110
2W	▲0.040	▲0.035	▲0.038	▲0.111
3W	-	-	-	▲0.114
1M	0.000	0.380	0.035	▲0.121
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.131
6M	-	-	-	▲0.146
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

8月10日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	企業物価指数(7月)	+2.9%	21:30	(米)7月消費者物価コア指数[前年比]	2.3%
8:50	4-6月期国内総生産速報値[前期比年率]	+1.4%	-	-	-
-	-	-	-	-	-

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

無担保コールON物は▲0.070%の出合から始まった。その後は主に▲0.070~▲0.025%の水準で取引される堅調な地合いとなった。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比+0.005%の▲0.055%となった。

O/N業態別出合レンジ

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.070 ~ ▲0.060	▲0.070 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

調達ニーズは継続と見込まれる。今積期最後の週末3日積となることから、一部では水準を切上げて調達する動きも出てくると考えられ、堅調な地合いになると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報 8月9日	日銀予想 8月10日	当社需給予想 8月13日
券	▲400	▲400	+1,000
財政	▲2,000	▲10,000	▲8,000
過不足	▲2,400	▲10,400	▲7,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+9,800	スタート	スタート
共通担保(全店)	▲200	▲200	▲2,600
CP等買入	-	▲100	-
社債等買入	-	-	-
国債補完供給	+1,500	+1,100	-
当座預金増減	+7,600	▲7,600	▲9,600
当座預金残高	3,853,700	3,846,100	3,836,500
準備預金残高	3,377,000	主な需給要因	
積み終了先	3,376,900	国庫短期証券	
超過準備	3,376,900	発行・償還(6M)	
非準備先残高	476,700	国債発行(30年)	
準備預金進捗率	99.9%	国庫短期証券発行・償還(3M)	
平均	80.6%	-	
乖離率	19.3%	-	

8月9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

国債補完供給(8/9~8/10)					
33,721	1,098	1,098	▲0.600	▲0.600	-
13,257	2	2	▲0.600	▲0.600	-

マネタリーベース[億円]
8月8日時点 4,939,400

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,136,200
8月10日以降の残り所要	-
積数	900
平均	100

国庫短期証券入札予定

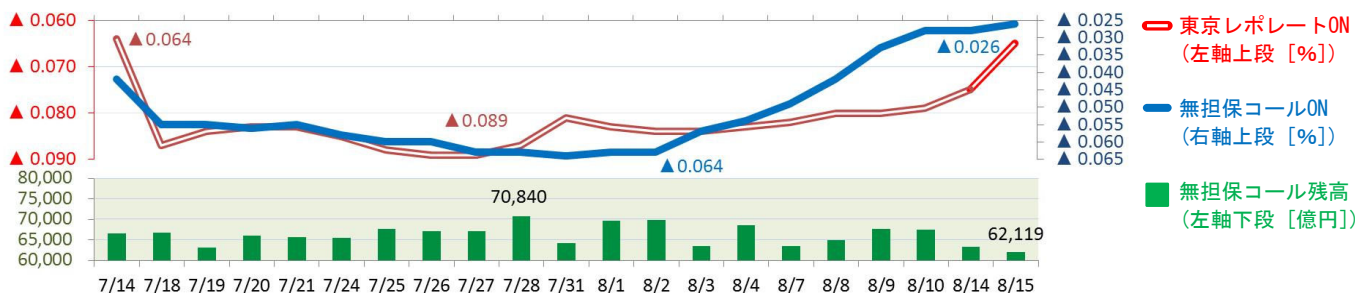
8月10日	3ヶ月	第776回
8月16日	1年	第777回
8月17日	3ヶ月	-
8月24日	3ヶ月	-
国債入札予定		
8月16日	5年	-
8月21日	20年	-
8月30日	2年	-
9月5日	10年	-

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