

### 短期市場の推移

[億円] [%]

	8月7日	8月8日	8月9日	8月10日
加重平均金利	▲0.066	▲0.060	▲0.055	▲0.047
東京レポレート(ON)	▲0.097	▲0.096	▲0.096	▲0.096
無コール残	71,689	83,815	86,514	77,848
ON	44,274	55,520	60,769	52,053
その他	27,415	28,295	25,745	25,795
有コール残	23,751	24,985	21,143	22,718

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14日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想	
10:00	営業毎旬報告 (8月10日現在)	-	18:00	(欧)4-6月期GDP 改定値[前年比]	2.1%
17:00頃	日銀が保有する 国債の銘柄別残高	-	18:00	(欧)6月鉱工業生産 指数[前月比]	▲0.5%
17:00頃	日銀によるTDBの 銘柄別買入額	-	15:00	(独)4-6月期GDP 改定値[前年比]	2.1%

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	▲0.085	0.001	▲0.051	▲0.095
T/N	-	-	0.000	▲0.100
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.028	▲0.032	▲0.108
2W	▲0.040	▲0.005	▲0.028	▲0.112
3W	-	-	0.000	▲0.114
1M	-	-	-	▲0.120
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.132
6M	-	-	-	▲0.146
1Y	-	-	-	▲0.156

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▲0.065%の出合から始まった。その後は昨日と同様、▲0.070~▲0.020%の広いレンジで取引されたが、週末3日積み目の要因が剥落したため、同加重平均金利(速報)は、前営業日対比▲0.004%の▲0.051%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.050		▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.065 ~ ▲0.020

### 翌営業日のマーケット

引き続き地銀業態を中心に、堅調な地合になると予想する。

### 資金需給

[億円]

	日銀速報 8月13日	日銀予想 8月14日	当社需給予想 8月15日
券	+100	▲300	+0
財政	▲7,200	▲3,300	+85,000
過不足	▲7,100	▲3,600	+85,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+5,000
国債買入			
共通担保(全店)	▲2,600	+8,400	
CP等買入	▲200	+2,200	
ETF買入		▲300	
国債補完供給	+1,900	▲3,000	+700
当座預金増減	▲400	+4,800	+85,000
当座預金残高	3,843,900	3,848,700	3,933,700
準備預金残高	3,368,500		
積み終了先	3,368,300		
超過準備	3,368,300		
非準備預金残高	475,400		
準備預金進捗率	99.9%	源泉税揚げ	年金定時払い 国債償還(2年)
平均	93.5%		
乖離率	6.4%		

### 8月13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(8/14~)	5,000	15,372	5,003	▲0.007	▲0.005	74.6
国債補完供給(8/13~8/14)	84,317	2,912	2,912	▲0.500	▲0.515	
	20,000	12	12	▲0.500	▲0.500	

マナタリーベース [億円]  
8月10日時点 4,938,400

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,136,200  
8月14日以降の残り所要  
積数 300  
平均 100

### 国庫短期証券入札予定

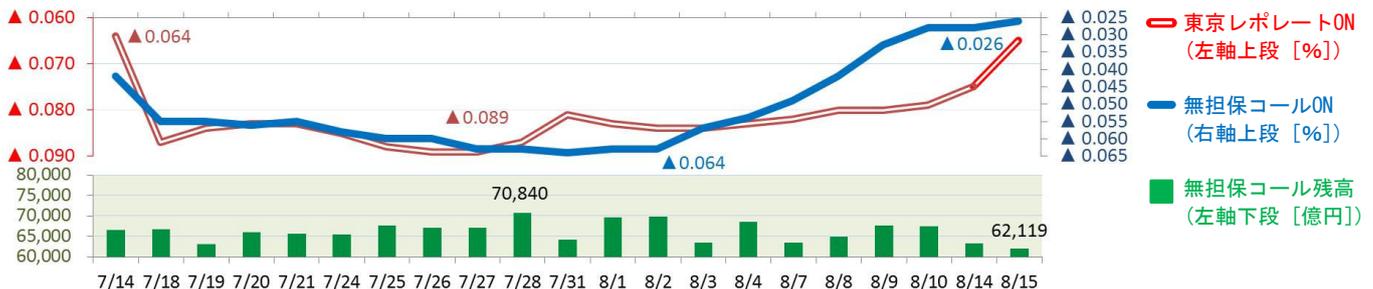
8月16日	1年	第777回
8月17日	3ヶ月	第778回
8月24日	3ヶ月	
8月31日	3ヶ月	
8月16日	5年	
8月21日	20年	
8月30日	2年	
9月5日	10年	

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