

短期市場の推移

[億円] [%]

	8月13日	8月14日	8月15日	8月16日
加重平均金利	▲0.051	▲0.051	▲0.052	▲0.067
東京レポレート(ON)	▲0.095	▲0.095	▲0.117	▲0.111
無コール残	78,123	82,668	76,331	72,568
ON	51,978	56,313	51,936	46,443
その他	26,145	26,355	24,395	26,125
有コール残	24,364	23,060	23,623	16,994

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	▲0.086	0.001	▲0.067	▲0.111
T/N	-	-	0.000	▲0.139
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.001	▲0.033	▲0.132
2W	▲0.040	0.000	▲0.017	▲0.133
3W	-	-	-	▲0.133
1M	-	-	-	▲0.134
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.139
6M	-	-	-	▲0.147
1Y	-	-	-	▲0.157

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20日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)アトランタ連銀総裁講演	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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

本日の無担保コールON物は、▲0.08%の出合から始まり、その後は▲0.086~▲0.040%のレンジで取引された。昨日同様、ビッドサイドは慎重な調達姿勢となり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.067%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.040	▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.085 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

引き続き、ビッドサイドが慎重な調達姿勢となることから、軟調な地合が予想される。

資金需給

[億円]

	日銀速報 8月17日	日銀予想 8月20日	当社需給予想 8月21日
券	+0	+500	+0
財政	▲13,700	▲8,100	+3,000
過不足	▲13,700	▲7,600	+3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+6,600
共通担保(全店)		▲1,300	+1,100
CP等買入	▲100	▲400	
国債補完供給	+2,200		
当座預金増減	▲9,700	▲1,600	+3,000
当座預金残高	3,923,200	3,921,600	3,924,600
準備預金残高	3,439,900	主な需給要因	
積み終了先	3,422,200		
超過準備	3,251,300	国庫短期証券	
非準備預金残高	483,300	発行・償還	
準備預金進捗率	98.7%	(3M・1Y)	
平均	12.9%		
乖離率	85.8%		

8月17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(8/20~)						
1~3年	2,500	9,734	2,507	▲0.008	▲0.006	2.0
3~5年	3,000	11,116	3,005	▲0.004	▲0.003	52.3
変動利付	1,000	2,738	1,002	▲0.140	▲0.208	41.9
国債補完供給(8/17~8/20)						
	34,765	34	34	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(8/20~9/3)						
	8,000	1,141	1,141			

マネタリーベース [億円]
8月16日時点 5,027,400

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,120,700
8月20日以降の残り所要
積数 39,300
平均 1,500

国庫短期証券入札予定

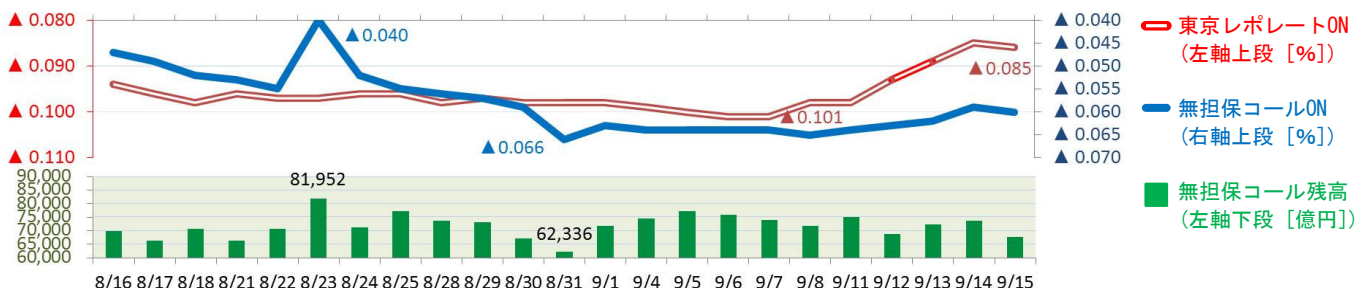
8月24日	3ヶ月	第779回
8月31日	3ヶ月	
9月6日	6ヶ月	
9月7日	3ヶ月	
国債入札予定		
8月21日	20年	
8月30日	2年	
9月5日	10年	
9月11日	30年	

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17日	2
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,000	3 8 15 22 24 31	8月15日	3
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800	3 10 15 22 29	8月15日	2
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	8月17日	0

1年前の市場推移

○2017年8月積み期 [8月16日~9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。