

短期市場の推移

[億円] [%]

	8月14日	8月15日	8月16日	8月17日
加重平均金利	▲0.051	▲0.052	▲0.067	▲0.067
東京レポレート(ON)	▲0.095	▲0.117	▲0.111	▲0.111
無コール残	82,668	76,331	72,568	74,795
ON	56,313	51,936	46,443	48,400
その他	26,355	24,395	26,125	26,395
有コール残	23,060	23,623	16,994	16,240

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	▲0.066	▲0.100
T/N	-	-	0.000	▲0.120
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.230	▲0.005	▲0.124
2W	-	-	▲0.040	▲0.129
3W	-	-	-	▲0.130
1M	-	-	▲0.015	▲0.132
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.139
6M	-	-	-	▲0.148
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21日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
14:00	7月のスーパー売上高		-	
	-		-	
	-		-	

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、▲0.085%の合出から始まり、その後は▲0.086~▲0.04%のレンジで取引された。先週末同様、軟調な地合いとなり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.066%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.080	▲0.085 ~ ▲0.080	▲0.086 ~ ▲0.025

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、軟調な地合いが予想される。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	8月20日	8月21日	8月22日
券	+500	+400	+0
財政	▲2,900	+1,600	▲12,000
過不足	▲2,400	+2,000	▲12,000
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)	▲1,300	+6,600	
CP等買入	▲400	+1,100	
国債補完供給		▲200	+200
当座預金増減	+3,400	+7,100	▲12,000
当座預金残高	3,926,600	3,933,700	3,921,700
準備預金残高	3,436,000	主な需給要因	
積み終了先	3,426,900		
超過準備	3,423,100		
非準備先残高	490,600		
準備預金進捗率	99.2%		
平均	16.1%		
乖離率	83.0%		

8月20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
国庫短期証券買入(8/21~)	5,000	16,421	5,004	0.000	0.001	51.8
国債補完供給(8/20~8/21)	130,700	179	179	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]
8月17日時点 5,017,600

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,120,700
8月21日以降の残リ所要
積数 26,400
平均 1,000

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

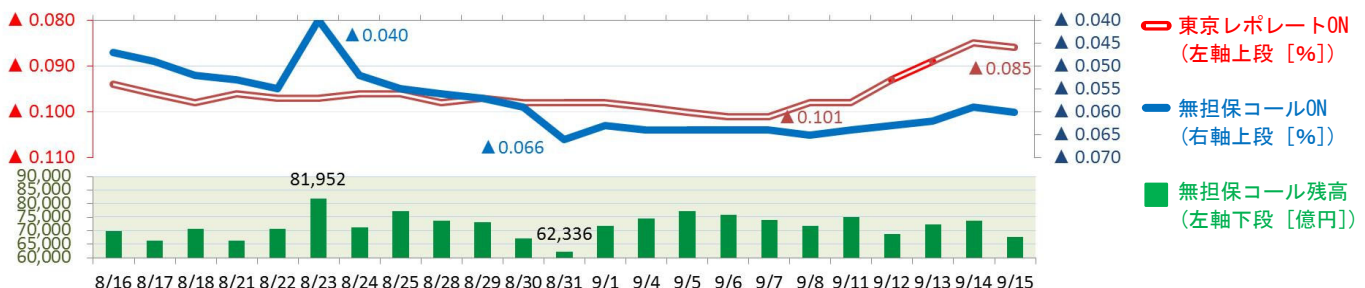
8月21日	20年
8月30日	2年
9月5日	10年
9月11日	30年

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。