

短期市場の推移

[億円] [%]

	8月17日	8月20日	8月21日	8月22日
加重平均金利	▲0.067	▲0.066	▲0.063	▲0.061
東京レポレート(ON)	▲0.111	▲0.100	▲0.099	▲0.101
無コール残	74,795	69,727	72,136	75,387
ON	48,400	42,822	45,061	48,102
その他	26,395	26,905	27,075	27,285
有コール残	16,240	26,732	22,468	19,004

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24日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	7月消費者物価コア指数[前年比]	-	21:30	(米)7月耐久財受注[前月比]	1.0%
	-			(米)パウエルFRB議長の講演(ジャクソンホール会合)	
	-			-	

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	▲0.055	▲0.104
T/N	-	-	0.000	▲0.138
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.042	▲0.040	▲0.041	▲0.132
2W	-	-	▲0.038	▲0.137
3W	-	-	-	▲0.137
1M	-	-	-	▲0.137
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.140
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

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▲0.085~▲0.025%のレンジで取引された。本日も引き続き地銀業態を中心に、出合の中心レートが上昇したため、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.006%の▲0.055%となった。

都銀・信託		証券	地銀	
▲0.086 ~ ▲0.080		▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.080 ~ ▲0.025	

翌営業日のマーケット

週末3日積みとなる明日も引き続き、地銀業態を中心にビッドが厚く、出合の中心レートは上昇方向と思われる。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	8月23日	8月24日	8月24日	8月27日	8月27日
券	▲1,400	▲200	▲200	▲200	+0
財政	▲200	▲4,400	▲4,400	▲3,000	▲3,000
過不足	▲1,600	▲4,600	▲4,600	▲3,000	▲3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入		+7,100			
共通担保(全店)				▲2,200	
CP等買入	▲300		▲400		
社債等買入			▲100		+800
ETF買入				+700	
被災地金融機関支援			▲900	+900	
国債補充供給	+300	▲400	+400		
当座預金増減	+5,100	▲4,000	▲4,000	▲4,400	
当座預金残高	3,921,500	3,917,500	3,917,500	3,913,100	
準備預金残高	3,427,200	主な需給要因			
積み終了先	3,424,600				
超過準備	3,424,400				
非準備預金残高	494,300				
準備預金進捗率	99.6%	国庫短期証券発行・償還(3M)			
平均	25.8%				
乖離率	73.8%				

8月23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
国債補充供給(8/23~8/24)	75,224	390	390	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
8月22日時点 5,009,800	今積期の所要準備額 3,120,700
	8月24日以降の残り所要積数 11,300
	平均 500

国庫短期証券入札予定

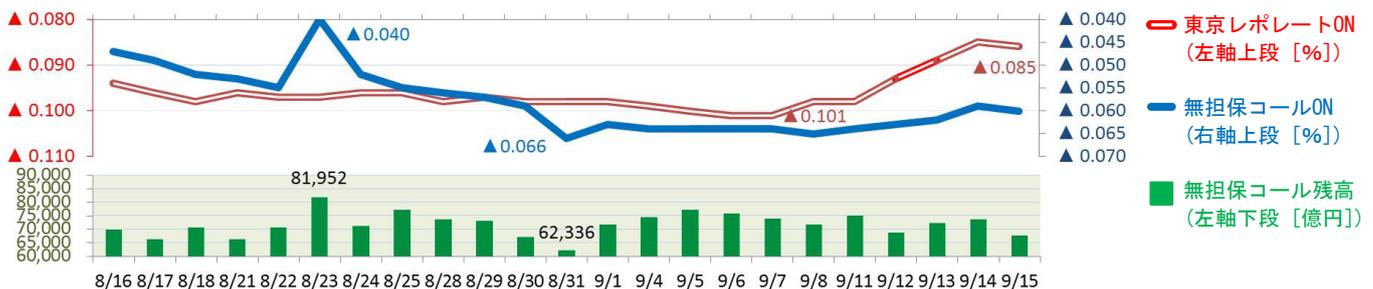
8月24日	3ヶ月	第7/79回
8月31日	3ヶ月	
9月6日	6ヶ月	
9月7日	3ヶ月	
9月30日	2年	
9月5日	10年	
9月11日	30年	
9月13日	5年	

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