

短期市場の推移

[億円] [%]

	8月20日	8月21日	8月22日	8月23日
加重平均金利	▲0.066	▲0.063	▲0.061	▲0.055
東京レポレート(ON)	▲0.100	▲0.099	▲0.101	▲0.104
無コール残	69,727	72,136	75,387	75,382
ON	42,822	45,061	48,102	47,097
その他	26,905	27,075	27,285	28,285
有コール残	26,732	22,468	19,004	16,135

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27日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	17:00 (独)8月IFO企業景況感指数	-
-	-	21:30 (米)7月シカゴ連銀全米活動指数	0.45
-	-	-	-

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	▲0.053	▲0.125
T/N	-	-	0.000	▲0.140
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.037	0.001	▲0.028	▲0.146
2W	-	-	0.020	▲0.141
3W	-	-	-	▲0.140
1M	-	-	-	▲0.141
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.141
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

週末3日積みとなる本日の無担保コールON物は、▲0.075%の割合から始まり、その後は▲0.08~▲0.025%のレンジで取引された。引き続き地銀業態の調達意欲が強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.053%と、4営業日連続で上昇した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.075	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.080 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

週明け以降も地銀業態を中心に堅調な地合いが継続すると思われる。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月24日	8月27日	8月27日	8月28日	8月28日	8月28日
券	▲100		+500		+0	
財政	▲4,800		+1,500		▲1,000	
過不足	▲4,900		+2,000		▲1,000	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国債買入				+9,600		
共通担保(全店)			▲2,200	+2,200		
CP等買入	▲400		▲300			
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	+400	▲400	+400			
当座預金増減	▲4,700		+12,500		▲1,000	
当座預金残高	3,916,800		3,929,300		3,928,300	
準備預金残高	3,423,100					
積み終了先	3,422,400					
超過準備	3,422,300					
非準備預金残高	493,700					
準備預金進捗率	99.7%					
平均	35.5%					
乖離率	64.2%					

8月24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
国債買入(8/27~)						
1~3年	2,500	9,284	2,503	0.005	0.006	8.7
3~5年	3,000	8,549	3,006	0.006	0.006	93.8
5~10年	4,000	11,682	4,008	0.006	0.007	29.9
国債補充供給(8/24~8/27)						
	60,000	398	398	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(8/27~9/10)						
	8,000	2,164	2,164			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
8月23日時点 5,016,300	今積期の所要準備額 3,120,700
	8月27日以降の残り所要積数 8,700
	平均 400

国庫短期証券入札予定

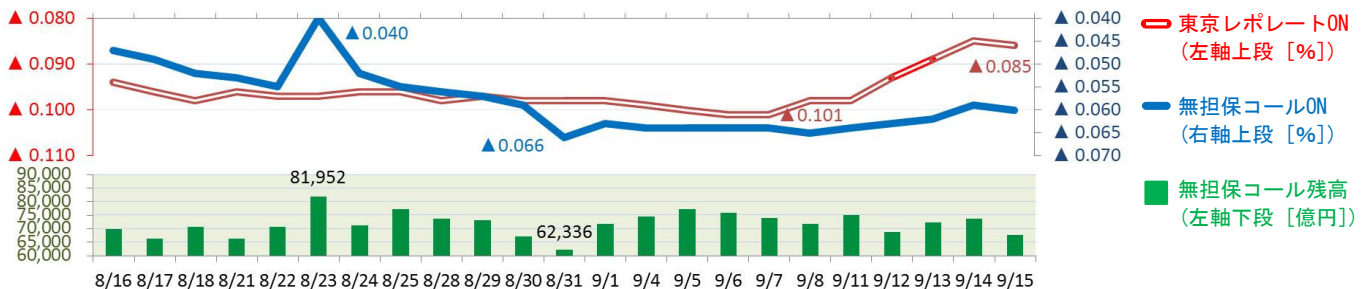
8月31日	3ヶ月	第780回
9月6日	6ヶ月	
9月7日	3ヶ月	
9月14日	3ヶ月	
国債入札予定		
8月30日	2年	
9月5日	10年	
9月11日	30年	
9月13日	5年	

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			
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			
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。