

短期市場の推移

[億円] [%]

	8月23日	8月24日	8月27日	8月28日
加重平均金利	▲0.055	▲0.053	▲0.054	▲0.051
東京レポレート(ON)	▲0.104	▲0.125	▲0.122	▲0.121
無コール残	75,382	80,530	83,251	85,296
ON	47,097	51,485	48,851	52,166
その他	28,285	29,045	34,400	33,130
有コール残	16,135	13,493	16,093	13,623

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	▲0.053	▲0.109
T/N	-	-	0.000	▲0.142
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	▲0.030	▲0.032	▲0.153
2W	▲0.037	▲0.030	▲0.033	▲0.143
3W	-	-	-	▲0.141
1M	-	-	-	▲0.141
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.141
6M	-	-	-	▲0.149
1Y	-	-	-	▲0.159

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30日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	国内銀行の資産・負債等(銀行勘定)(7月末)	-	21:30	(米)7月個人所得 0.4%
	-	-	21:30	(米)7月個人消費支出 0.4%
	-	-	21:30	(米)7月個人消費支出(PCE)価格コア指数[前年比] 2.0%

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、▲0.055%の合出から始まった。その後は主に▲0.075~▲0.025%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.053%となった。

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

翌営業日のマーケット

引き続き、地銀業態を中心に調達ニーズが底堅い展開を予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	8月29日	8月30日	8月31日
券		+300	▲800
財政		▲9,600	▲2,100
過不足		▲9,300	▲2,900
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+3,200
CP等買入	▲100	▲300	+2,000
ETF買入		+300	
国債補完供給	+900	▲400	+400
当座預金増減	▲8,600	+400	+3,000
当座預金残高	3,924,900	3,925,300	3,928,300
準備預金残高	3,427,500	主な需給要因	
積み終了先	3,426,900		
超過準備	3,426,900		
非準備先残高	497,400		
準備預金進捗率	99.8%		
平均	45.2%		
乖離率	54.6%		

8月29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(8/30~)						
~1年	500	1,528	500	0.038	0.040	93.0
10~25年	1,800	6,321	1,823	0.008	0.009	42.2
25年~	600	2,232	605	0.010	0.010	89.8
国債補完供給(8/29~8/30)						
	35,638	395	395	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]
8月28日時点 5,028,300

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,120,700
8月30日以降の残り所要
積数 6,700
平均 400

国庫短期証券入札予定

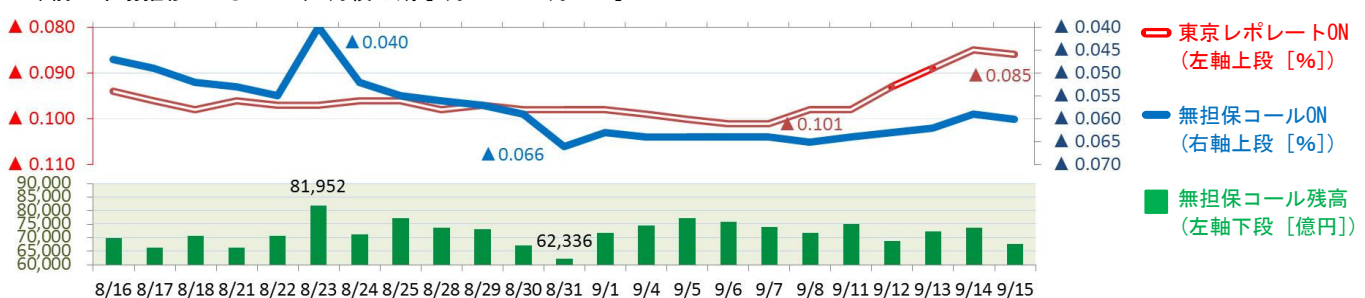
8月31日	3ヶ月	第780回
9月6日	6ヶ月	
9月7日	3ヶ月	
9月14日	3ヶ月	
国債入札予定		
8月30日	2年	
9月5日	10年	
9月11日	30年	
9月13日	5年	

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