

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年8月21日(水)

短期市場の推移

	8月15日	8月16日	8月19日	8月20日
加重平均金利	▲0.020	▲0.057	▲0.061	▲0.059
東京レポレート(ON)	▲0.090	▲0.085	▲0.084	▲0.080
無コール残	93,833	91,547	90,233	88,403
ON	64,253	60,767	58,683	56,773
その他	29,580	30,780	31,550	31,630
有コール残	17,786	20,163	21,640	22,042

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22日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:00	営業毎旬報告 (8月20日現在)	-	17:00	(欧)8月購買担当者 総合指数(PMI) 51.2
17:00頃	日本銀行が保有する 国債の銘柄別残高	-	22:45	(米)8月製造業PMI 50.5
17:00頃	日本銀行による国庫短期 証券の銘柄別買入額	-	22:45	(米)8月サービス業PMI 52.8

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	▲0.080	0.001	▲0.058	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.025	▲0.036	▲0.088
2W	▲0.040	▲0.010	▲0.023	▲0.091
3W	-	-	-	▲0.095
1M	-	-	▲0.040	▲0.101
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.120
6M	-	-	-	▲0.152
1Y	-	-	-	▲0.163

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、▲0.060%の合出から始まった。
その後は、主に▲0.070%~▲0.045%の水準で取引された。
同加重平均金利(速報)は▲0.058%(前営業日対比+0.001%)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.055	▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.065 ~ ▲0.045

翌営業日のマーケット

調達サイドの動向に大きな変化はなく、地合いは横ばいと予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月21日	8月22日	8月22日	8月23日	8月23日	8月24日
券		+0	▲900	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政		▲13,800	▲1,000	▲6,000	▲6,000	▲6,000
過不足		▲13,800	▲1,900	▲7,000	▲7,000	▲7,000
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
国庫短期証券買入			+5,000			
CP等買入	▲300		▲500			
ETF買入		+100				
被災地金融機関支援					▲900	
当座預金増減		▲14,000	+2,600	▲7,900	▲7,900	▲7,900
当座預金残高		4,013,600	4,016,200	4,008,300	4,008,300	4,008,300
準備預金残高		3,470,800				
積み終了先		3,468,400				
超過準備		3,467,200				
非準備預金残高		542,800				
準備預金進捗率		99.6%				
平均		19.4%				
乖離率		80.3%				

8月21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
国庫短期証券買入(8/22~)	5,000	18,586	5,003	0.004	0.010	27.2
国債補完供給(8/21~8/22)			11	11	▲0.350	▲0.350

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
8月20日時点 5,149,500	今積期の所要準備額 3,179,400
	8月22日以降の残り所要積数 11,400
	平均 500

国庫短期証券入札予定

8月23日	3ヶ月	第853回
8月30日	3ヶ月	
9月6日	3ヶ月	
9月9日	6ヶ月	
8月29日	2年	
9月3日	10年	
9月5日	30年	
9月11日	5年	

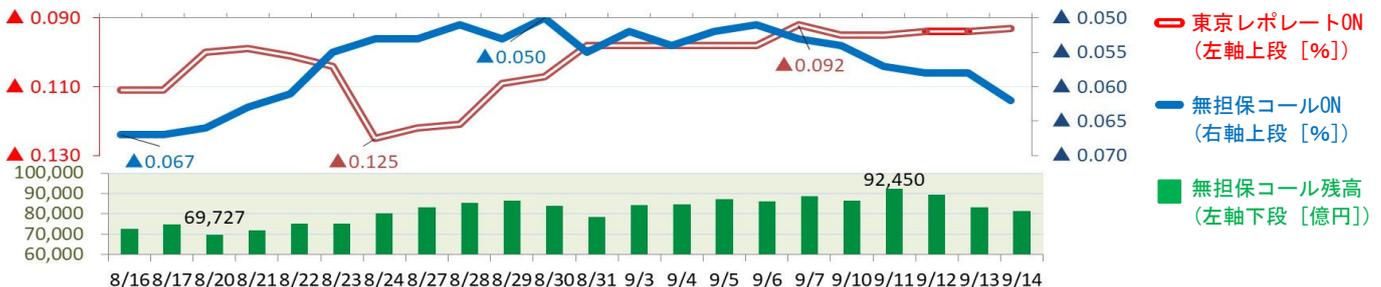
今月の国債買入オペ予定

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5日	1
1年超3年以下	2,500~5,000 程度	4,000			
3年超5年以下	2,500~5,000 程度	3,600	9 19 23 30	8月19日	2
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,500	5 16 23 30	8月16日	2
10年超25年以下	1,000~2,500 程度	1,600			
25年超	100~1,000 程度	400	2 9 26	8月9日	1
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	8月2日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	月1回	8月5日	0

1年前の市場推移

○2018年8月積み期 [8月16日~9月14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。