

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年8月22日(木)

短期市場の推移

	8月16日	8月19日	8月20日	8月21日
加重平均金利	▲0.057	▲0.061	▲0.059	▲0.058
東京レポレート(ON)	▲0.085	▲0.084	▲0.080	▲0.085
無コール残	91,547	90,233	88,403	87,411
ON	60,767	58,683	56,773	54,191
その他	30,780	31,550	31,630	33,220
有コール残	20,163	21,640	22,042	19,590

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23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]	+0.6%	23:00	(米)7月新築住宅販売件数	64.5万戸
				(米)パウエルFRB議長の講演(ジャクソンホール)	

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	▲0.078
T/N	-	-	-	▲0.080
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.040	▲0.084
2W	-	-	▲0.040	▲0.088
3W	-	-	-	▲0.093
1M	-	-	-	▲0.101
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.120
6M	-	-	-	▲0.151
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、▲0.065%の出合から始まった。その後は、主に▲0.070%~▲0.050%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は▲0.058%と前営業日対比横ばいだった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.065	▲0.060 ~ ▲0.055	▲0.070 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

週末3日積みではあるものの、取り上がる展開にはならず、横ばいでの出合水準を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月22日	8月23日	8月22日	8月23日	8月26日	8月27日
券	▲1,000	▲500	▲1,000	▲500	+1,000	+1,000
財政	+100	+1,100	+100	+1,100	+1,000	+1,000
過不足	▲900	+600	▲900	+600	+2,000	+2,000
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				
共通担保(全店)					▲600	
CP等買入	▲500		▲400			
社債等買入						+1,300
ETF買入				+700		
被災地金融機関支援			▲900	+900		
国債補充供給	▲400	+400				
当座預金増減	+3,200	+1,300	+3,200	+1,300	+2,700	+2,700
当座預金残高	4,016,800	4,018,100	4,016,800	4,018,100	4,020,800	4,020,800
準備預金残高	3,478,100		3,478,100			
積み終了先	3,476,300		3,476,300			
超過準備	3,476,000		3,476,000			
非準備先残高	538,700		538,700			
準備預金進捗率	99.7%		99.7%			
平均	22.6%		22.6%			
乖離率	77.1%		77.1%			

8月22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(8/22~8/23)						
	20	20	▲0.350	▲0.350		
	326	326	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース [億円]
8月21日時点 5,135,400

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,179,400
8月23日以降の残り所要積数 9,300
平均 400

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	

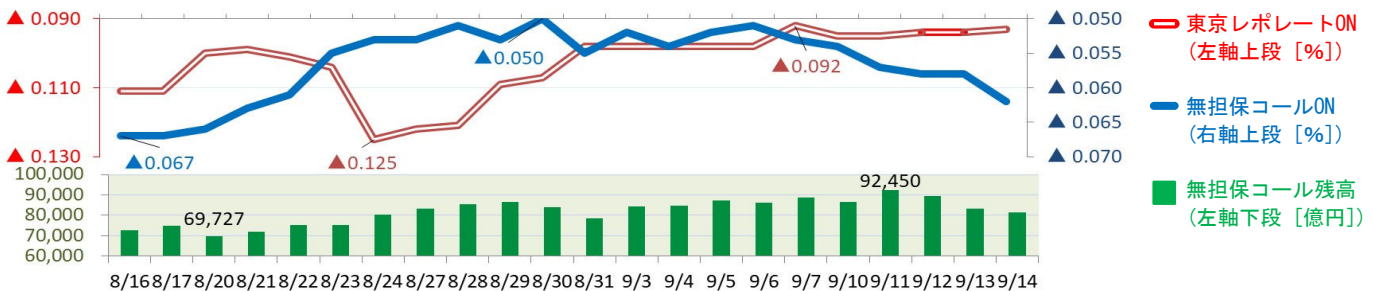
今月の国債買入オペ予定

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
物価運動債	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。