

短期市場の推移

	8月20日	8月21日	8月22日	8月23日
加重平均金利	▲0.059	▲0.058	▲0.058	▲0.052
東京レポレート(ON)	▲0.080	▲0.085	▲0.078	▲0.080
無コール残	88,403	87,411	95,078	91,899
ON	56,773	54,191	61,333	57,854
その他	31,630	33,220	33,745	34,045
有コール残	22,042	19,590	22,067	20,306

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
8:50 企業向けサービス価格指数(7月)	-	15:00 (独)4-6月期国内総生産(GDP)改定値[前年比]	-
-	-	23:00 (米)8月消費者信頼感指数	130.0
-	-	-	-

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	▲0.047	▲0.083
T/N	-	-	-	▲0.083
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.040	▲0.086
2W	▲0.040	▲0.020	▲0.035	▲0.088
3W	-	-	0.000	▲0.093
1M	-	-	-	▲0.101
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.124
6M	-	-	-	▲0.153
1Y	-	-	-	▲0.164

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、▲0.050%の出合から始まった。その後は、主に▲0.055%~▲0.040%の水準で取引された。週初ではあるもののビッドサイドの調達意欲は強く、同加重平均金利(速報)は▲0.047%(前営業日対比+0.005%)に上昇した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.050	▲0.050 ~ ▲0.045	▲0.055 ~ ▲0.040

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達ニーズは強く、出合レートは小幅上昇を予想する。

資金需給

	日銀速報 8月26日	日銀予想 8月27日	当社需給予想 8月28日
券	+500	+100	+0
財政	+4,900	+1,000	▲5,000
過不足	+5,400	+1,100	▲5,000
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	+12,600	+2,700	-
共通担保(全店)	▲600	+900	-
CP等買入	▲500	▲200	-
社債等買入	+1,300	-	-
ETF買入	+700	+600	-
当座預金増減	+19,800	+4,200	▲5,000
当座預金残高	4,037,500	4,041,700	4,036,700
準備預金残高	3,512,600	主な需給要因	
積み終了先	3,511,800	-	-
超過準備	3,511,800	-	-
非準備預金残高	524,900	-	-
準備預金進捗率	99.8%	-	-
平均	35.5%	-	-
乖離率	64.3%	-	-

8月26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~)						
10~25年	1,600	6,270	1,604	▲0.038	▲0.034	51.4
25年~	400	1,428	401	▲0.045	▲0.043	46.2
物価連動	250	1,350	251	0.000	▲0.119	43.5
国債補完供給(8/26~8/27)			39	39	▲0.350	▲0.350

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
8月23日時点 5,141,100	今積期の所要準備額 3,179,400
	8月27日以降の残り所要積数 6,300
	平均 300

国庫短期証券入札予定

8月30日	3ヶ月	第854回
9月6日	3ヶ月	
9月9日	6ヶ月	
9月13日	3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23日	1
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,500	5 16 23 30	8月23日	1
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26日	0
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	8月26日	0
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	月1回	8月5日	-

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。 上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会