DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社
TEL:0120-327-017

平成30年8月21日(火)

短期市場の推移 [億円][%]

	8月15日	8月16日	8月17日	8月20日
加重平均金利	▲0.052	▲0.067	▲0.067	▲0.066
東京レポレート(ON)	▲0.117	▲0.111	▲0.111	▲0.100
無コール残	76,331	72,568	74,795	69,727
ON	51,936	46,443	48,400	42,822
その他	24,395	26,125	26,395	26,905
有コール残	23,623	16,994	16,240	26,732

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)	-	20:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]	-
17:00頃	日本銀行が保有する国債の銘柄別残高	-	23:00	(米)7月中古住宅販売件数	545万件
17:00頃	日本銀行による国庫短期証券の銘柄別買入額	-		FOMC議事録(7月31日～8月1日分)	

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) 最低	最高	平均	レポ市場 東京レポレート
O/N	▲0.086	0.010	▲0.063	▲0.099
T/N	-	-	0.000	▲0.114
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.048	▲0.030	▲0.042	▲0.121
2W	▲0.040	▲0.020	▲0.025	▲0.126
3W	-	-	-	▲0.129
1M	-	-	-	▲0.131
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.138
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

本日の無担保コールON物は、▲0.085%の出合から始まり、その後は▲0.086～▲0.025%のレンジで取引された。一部、試し取りによる+0.001%での出合が見られたこともあり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.003%の▲0.063%となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
▲ 0.086 ～ ▲ 0.080	▲ 0.075 ～ ▲ 0.075	▲ 0.086 ～ ▲ 0.025

翌営業日のマーケット

地銀業態を中心に調達意欲が若干強まると予想されるため、出合レンジも小幅上昇方向と思われる。

資金需給 [億円]

	日銀速報 8月21日		日銀予想 8月22日		当社需給予想 8月23日	
券		+400		+100		▲1,000
財政		+1,400		▲14,100		+0
過不足		+1,800		▲14,000		▲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
国庫短期証券買入		+5,000				
CP等買入	▲100		▲100			
国債補完供給	+200	▲100	+100			
当座預金増減		+6,800		▲14,000		▲1,000
当座預金残高		3,933,400		3,919,400		3,918,400
準備預金残高		3,440,100	主な需給要因			
積み終了先		3,432,700				
超過準備		3,431,800				
非準預先残高		493,300	国債発行(20年)			
準備預金進捗率		99.4%				
平均		19.4%				
乖離率		80.1%				

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	按分
米ドル資金供給(8/23～8/30)		2	2	2.420	2.420	
社債等買入(8/27～)		750	2,230	750	▲0.049	▲0.036	35.0
国債補完供給(8/21～8/22)		20,000	63	63	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]
8月20日時点 5,020,500

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,120,700
8月22日以降の残り所要
積数 18,200
平均 700

国庫短期証券入札予定

8月24日	3ヶ月	第779回
8月31日	3ヶ月	
9月6日	6ヶ月	
9月7日	3ヶ月	

国債入札予定

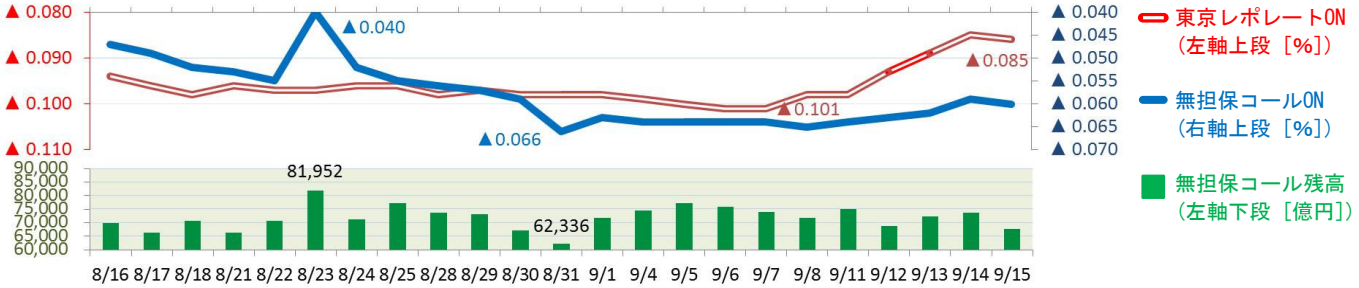
8月30日	2年
9月5日	10年
9月11日	30年
9月13日	5年

今月の国債買入オペ予定 [億円]

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	1	8	10	17	24	31	8月17日	2
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	3	8	15	22	24	31	8月15日	3
10年超25年以下	1,500～2,500 程度	1,800	3	10	15	22	29		8月15日	2
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8日	1
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。

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