

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年8月22日(水)

短期市場の推移

[億円][%]

	8月16日	8月17日	8月20日	8月21日
加重平均金利	▲0.067	▲0.067	▲0.066	▲0.063
東京レポレート(ON)	▲0.111	▲0.111	▲0.100	▲0.099
無コール残	72,568	74,795	69,727	72,136
ON	46,443	48,400	42,822	45,061
その他	26,125	26,395	26,905	27,075
有コール残	16,994	16,240	26,732	22,468

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
-	-	カンガシテシ連銀主催のジャクソンホール会合(25日まで)	-
-	-	21:30 (米)新規失業保険申請件数[前週分]	-
-	-	23:00 (米)7月新築住宅販売件数	65.0万戸

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	▲0.086	0.001	▲0.061	▲0.101
T/N	-	-	0.000	▲0.122
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.041	▲0.040	▲0.040	▲0.123
2W	▲0.038	▲0.010	▲0.024	▲0.129
3W	-	-	-	▲0.131
1M	-	-	-	▲0.133
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.139
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。地銀業態を中心に、出合の中心レートが小幅上昇したため、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.061%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.080	▲0.070 ~ ▲0.055	▲0.086 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

引き続き、地銀業態を中心にビッドが厚く、出合の中心レートは小幅上昇方向と思われる。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月22日	8月23日	8月23日	8月24日	8月24日	8月24日
券		+200	▲1,400	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政		▲16,900	+900	▲6,000	▲6,000	▲6,000
過不足		▲16,700	▲500	▲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
国債買入				+7,100		
CP等買入	▲100		▲300			
被災地金融機関支援					▲900	+900
国債補完供給	+100	▲300	+300			
当座預金増減		▲17,000	+6,600	▲7,000	▲7,000	▲7,000
当座預金残高		3,916,400	3,923,000	3,916,000	3,916,000	3,916,000
準備預金残高		3,423,500				
積み終了先		3,420,200				
超過準備		3,419,300				
非準備預金残高		492,900				
準備預金進捗率		99.6%				
平均		22.6%				
乖離率		77.0%				

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
国債買入(8/23~)						
5~10年	4,000	13,436	4,013	0.001	0.001	65.7
10~25年	1,800	6,760	1,819	▲0.002	▲0.002	77.9
25年~	600	1,578	606	0.000	0.002	10.2
物価連動	250	1,293	251	▲0.160	▲0.208	52.2
国債補完供給(8/22~8/23)						
	39,144	278	278	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
8月21日時点 5,027,000	今積期の所要準備額 3,120,700
	8月23日以降の残り所要積数 14,000
	平均 600

国庫短期証券入札予定

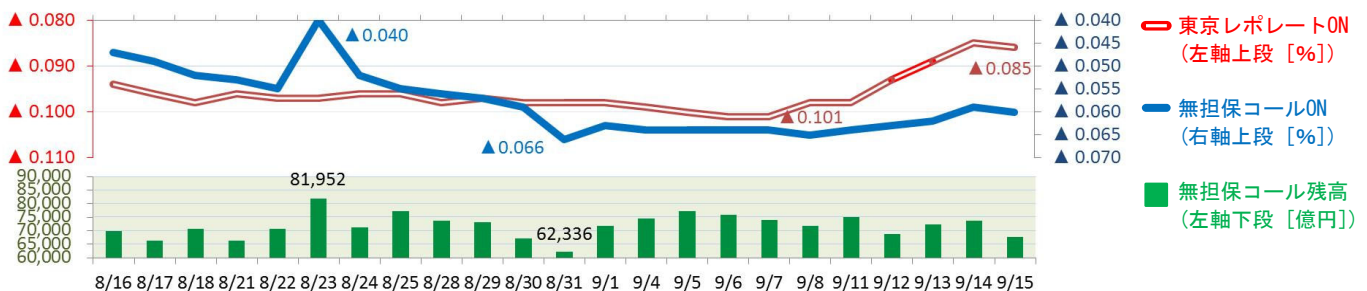
8月24日	3ヶ月	第7/79回
8月31日	3ヶ月	
9月6日	6ヶ月	
9月7日	3ヶ月	
9月30日	2年	
9月5日	10年	
9月11日	30年	
9月13日	5年	

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1日	1
1年超3年以下	2,000~3,000 程度	2,500			
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			
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。

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