



デイリーシグナル

2022年8月15日(月)

短期市場の推移

	8月8日	8月9日	8月10日	8月12日
加重平均金利	▲0.009	▲0.009	▲0.008	▲0.008
東京レポレート(TN)	▲0.088	▲0.086	▲0.087	▲0.087
無コール残	154,958	147,153	146,034	139,031
ON	77,815	70,210	71,606	66,623
その他	77,143	76,943	74,428	72,408
有コール残	28,834	29,142	29,178	29,641

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。

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	▲0.035	0.001	▲0.007	▲0.088
T/N	▲0.020	▲0.012	▲0.019	▲0.088
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.099
2W	▲0.022	▲0.002	▲0.015	▲0.103
3W	-	-	▲0.020	▲0.110
1M	▲0.020	▲0.015	▲0.018	▲0.116
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.005	▲0.123
6M	-	-	-	▲0.146
1Y	-	-	-	▲0.141

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

8月16日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
7月の業感別の日銀当座預金残高(日銀)		22:15 (米)7月鉱工業生産指数[前月比]	0.3%
-	-	-	-
-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.007%の合出から始まり、その後は主に▲0.007%~▲0.005%の水準で取引された。積み最終日ということで、ビッドサイドの調達意欲が強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.007%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.007 ~ ▲0.006	- ~ -	▲0.007 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

積み初日となる明日は、ビッドサイドが慎重な動きとなるため、出合いの水準は本日対比で低下を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月15日	8月16日	8月16日	8月17日	8月17日	8月18日
券		+400		+200		+0
財政		+69,500		▲1,000		▲27,000
過不足		+69,900		▲800		▲27,000
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
共通担保(全店)					▲2,100	
CP等買入	▲300	+4,000	▲500			
国債補完供給	+9,800	▲10,400	+10,400			
当座預金増減		+73,000		+9,100		▲29,100
当座預金残高		5,380,800		5,389,900		5,360,800
準備預金残高		4,742,900				
積み終了先		4,742,900				
超過準備		4,742,900				
非準備先残高		637,900				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		100.0%				
乖離率		0.0%				

8月15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
国債買入(固定利回り方式)(8/16~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(8/15~8/16)						
	10,228	10,228	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
8月12日時点 6,561,000

所要	(億円)
来積期の所要準備額	3,873,500
8月16日以降の残り所要	
積数	3,873,500
平均	125,000

国債短期証券入札予定

8月18日	1年(第1102回)
8月19日	3ヶ月(第1103回)
8月26日	3ヶ月
9月2日	3ヶ月
8月16日	5年
8月18日	20年
8月30日	2年
9月1日	10年

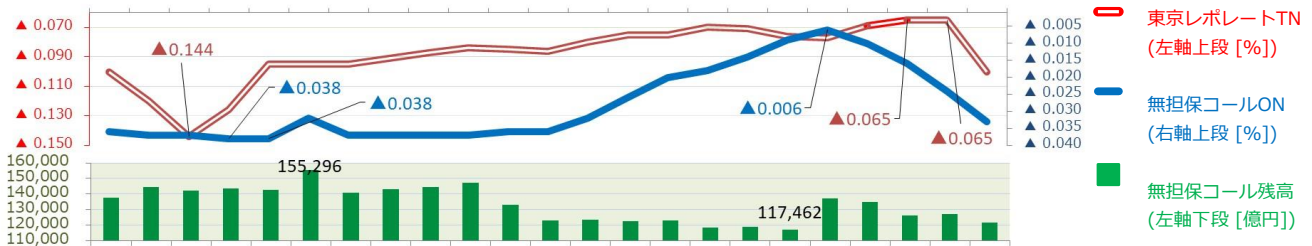
今日の国債買入オペ予定

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	1500	1,500	月1回	8月3日	0
1年超3年以下	4750	4,750	3 10 17 24	8月10日	2
3年超5年以下	4750	4,750	3 10 24 31	8月10日	2
5年超10年以下	5000	5,000	10 17 24 31	8月10日	3
10年超25年以下	1250	1,250	3 31	8月3日	1
25年超	500	500	17 31	7月29日	2
物価連動債	600	600	月1回	7月29日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	7月13日	0

1年前の市場推移

○2021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