



デイリーシグナル

2022年8月19日(金)

短期市場の推移

	8月15日	8月16日	8月17日	8月18日
加重平均金利	▲0.007	▲0.018	▲0.014	▲0.010
東京レポレート(TN)	▲0.088	▲0.088	▲0.088	▲0.088
無コール残	130,780	132,874	133,331	139,120
ON	62,097	65,991	63,298	67,327
その他	68,683	66,883	70,033	71,793
有コール残	30,595	30,297	30,726	30,525

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	▲0.047	0.001	▲0.009	▲0.085
T/N	▲0.010	▲0.008	▲0.009	▲0.088
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.005	▲0.094
2W	▲0.023	▲0.006	▲0.014	▲0.099
3W	▲0.020	▲0.015	▲0.017	▲0.104
1M	-	-	▲0.040	▲0.113
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.124
6M	-	-	-	▲0.145
1Y	-	-	-	▲0.142

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22日の予定 (時刻は日本時間)

	日本		海外	
		予想		予想
	-		-	
	-		-	
	-		-	

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▲0.008%の合出から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.005%の水準で取引された。週末3日積みのため調達ニーズは引き続き強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.009%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.010	▲0.010 ~ ▲0.005	▲0.010 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

週末3日積み要因が剥落するものの調達サイドの資金ニーズは強く出合いの水準は横ばい圏と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月19日	8月22日	8月22日	8月23日	8月23日	8月23日
券	+200	+600	+600	+1,000	+1,000	+1,000
財政	▲3,100	▲2,900	▲2,900	▲3,000	▲3,000	▲3,000
過不足	▲2,900	▲2,300	▲2,300	▲2,000	▲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
CP等買入	▲100	▲300	▲300			
社債等買入				+800		
被災地金融機関支援	▲2,900	+400				
国債補完供給	+8,300	▲9,000	+9,000			
当座預金増減	▲6,200	+7,200	+7,200	▲2,000	▲2,000	▲2,000
当座預金残高	5,356,300	5,363,500	5,363,500	5,361,500	5,361,500	5,361,500
準備預金残高	4,669,000	4,665,700	4,665,700	主な需給要因		
積み終了先				国庫短期証券発行・償還		
超過準備	4,663,900			(1Y/3M)		
非準備先残高	687,300					
準備預金進捗率	99.7%					
平均	19.4%					
乖離率	80.4%					

8月19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)(8/22~)						
5~10年	0	0	0			
5~10年	0	0	0			
国債補完供給(8/19~8/22)						
	8,898	8,898	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
8月18日時点 6,615,500

所要	今積期の所要準備額	8月22日以降の残り所要	積数	平均
	3,873,500		11,400	500

国庫短期証券入札予定

8月26日	3ヶ月(第1104回)
9月2日	3ヶ月
9月8日	6ヶ月
9月9日	3ヶ月

国債入札予定

8月30日	2年
9月1日	10年
9月6日	30年
9月13日	5年

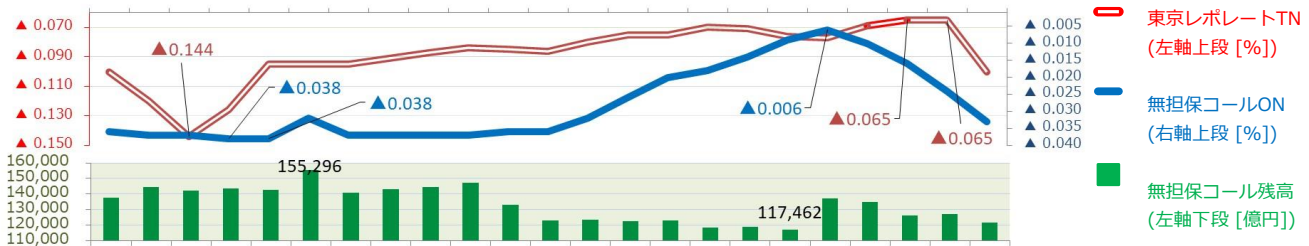
今月の国債買入オペ予定

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	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17日	1
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17日	2
10年超25年以下	1250	1,250	3 31	8月3日	1
25年超	500	500	17 31	8月17日	1
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