

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年8月17日(月)

短期市場の推移

	8月11日	8月12日	8月13日	8月14日
加重平均金利	▲0.020	▲0.019	▲0.016	▲0.024
東京レポレート(ON)	▲0.055	▲0.064	▲0.089	▲0.076
無コール残	93,538	97,350	93,560	90,819
ON	63,690	67,402	64,542	62,731
その他	29,848	29,948	29,018	28,088
有コール残	19,681	19,765	18,801	17,222

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18日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30	(米)7月住宅着工件数
-	-	-	123.0万戸
-	-	-	-
-	-	-	-

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	▲0.080	0.001	▲0.053	▲0.071
T/N	-	-	▲0.001	▲0.072
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.000	▲0.072
2W	▲0.035	▲0.010	▲0.024	▲0.074
3W	-	-	-	▲0.078
1M	▲0.029	▲0.015	▲0.022	▲0.084
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.094
6M	-	-	-	▲0.147
1Y	-	-	-	▲0.172

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%の出合から始まり、その後は主に▲0.065%~▲0.030%の水準で出合が見られた。新積み期に入ったためビッドサイドは慎重な姿勢となり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.029%の▲0.053%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.060 ~ ▲0.050	▲0.055 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

様子見姿勢の強いマーケットとなり、出合水準は本日対比で小幅下落を予想。

資金需給

	日銀速報 8月17日	日銀予想 8月18日	当社需給予想 8月19日
券	+900	+1,200	+0
財政	▲20,400	▲1,400	▲8,000
過不足	▲19,500	▲200	▲8,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲600	▲100	-
ETF買入	+800	-	-
国債補完供給	+300	+400	-
当座預金増減	▲19,400	+100	▲8,000
当座預金残高	4,518,200	4,518,300	4,510,300
準備預金残高	3,936,300	主な需給要因	
積み終了先	3,851,900	国債発行(30年)	
超過準備	3,364,500	準備預金進捗率	
非準備先残高	581,900	平均	
準備預金進捗率	98.4%	乖離率	
平均	6.5%		
乖離率	91.9%		

8月17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
国債補完供給(8/17~8/18)	318	318	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
8月14日時点 5,725,100

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,499,200
8月18日以降の残り所要積数 57,500
平均 2,000

国庫短期証券入札予定

8月19日	1年	第930回
8月21日	3ヶ月	第931回
8月24日	6ヶ月	第932回
8月28日	3ヶ月	
8月18日	30年	
8月20日	5年	
8月25日	20年	
8月27日	2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	500~1,500	1,000	月3回程度	8月7日	2
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	3 7 13 21 26 31	8月13日	3
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	5 13 19 24 26 31	8月13日	4
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	7 13 19 21 26	8月13日	3
10年超25年以下	500~2,000	1,200	5 28	8月5日	1
25年超	0~500	300	21 28	7月31日	2
物価連動債	300	300	月2回程度	8月3日	1
変動利付債<偶数月>	1,000	1,000	月1回	8月5日	0

1年前の市場推移

○2019年8月積み期 [8月16日~9月13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。