

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年8月19日(水)

短期市場の推移

	8月13日	8月14日	8月17日	8月18日
加重平均金利	▲0.016	▲0.024	▲0.052	▲0.045
東京レポレート(ON)	▲0.089	▲0.076	▲0.071	▲0.075
無コール残	93,560	90,819	89,152	93,371
ON	64,542	62,731	61,914	66,113
その他	29,018	28,088	27,238	27,258
有コール残	18,801	17,222	18,596	18,278

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20日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		21:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分]
		23:00	(米)7月景気先行指数
			1.0%

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	▲0.075	0.001	▲0.040	▲0.068
T/N	-	-	▲0.001	▲0.070
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.005	▲0.018	▲0.072
2W	▲0.035	▲0.010	▲0.018	▲0.074
3W	-	-	▲0.030	▲0.079
1M	-	-	-	▲0.083
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▲0.045%の出合から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.030%の水準で出合が見られた。地銀業態の調達ニーズが強いことに加え、一部金融機関によるプラス圏での試し取りが行われたことから同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.005%の▲0.040%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.050	▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.050 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲は強く、堅調な地合を予想。

資金需給

	日銀速報 8月19日	日銀予想 8月20日	当社需給予想 8月21日
券	+0	▲200	▲1,000
財政	▲9,800	▲23,700	▲22,000
過不足	▲9,800	▲23,900	▲23,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+25,000		
国債買入			+8,100
CP等買入	▲300	▲400	+5,400
ETF買入	+900		
被災地支援			▲900
国債補完供給	▲200	+200	+2,000
米ドル用担保国債供給			+900
当座預金増減	+15,600	▲10,600	▲21,000
当座預金残高	4,535,400	4,524,800	4,503,800
準備預金残高	3,958,500		
積み終了先	3,954,600		
超過準備	3,948,300		
非準備先残高	576,900		
準備預金進捗率	99.7%	国庫短期証券 発行・償還(1Y)	国債発行(5年)
平均	12.9%		
乖離率	86.8%		

8月19日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(8/20~)						
3~5年	3,500	10,957	3,506	0.005	0.006	12.6
5~10年	4,200	6,838	4,209	0.001	0.003	50.1
国債補完供給(8/19~8/20)						
		161	161	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
8月18日時点 5,705,100	今積期の所要準備額 3,499,200
	8月20日以降の残り所要積数 10,400
	平均 400

国庫短期証券入札予定

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	
9月4日	3ヶ月	
8月20日	5年	
8月25日	20年	
8月27日	2年	
9月1日	10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19日	3
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	7 13 19 21 26	8月19日	2
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。