

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年8月2日(金)

短期市場の推移

	7月29日	7月30日	7月31日	8月1日
加重平均金利	▲0.072	▲0.071	▲0.071	▲0.070
東京レポレート(ON)	▲0.079	▲0.077	▲0.074	▲0.065
無コール残	87,534	81,160	82,674	91,366
ON	51,629	47,705	50,064	58,326
その他	35,905	33,455	32,610	33,040
有コール残	22,811	21,149	22,309	22,224

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5日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	日銀当座預金増減要因 (8月見込み)	-	23:00	(米)7月ISM非製造業 景況指数	55.5

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	▲0.063	▲0.062
T/N	-	-	-	▲0.059
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	0.000	▲0.041	▲0.062
2W	▲0.040	0.000	▲0.029	▲0.068
3W	-	-	0.000	▲0.078
1M	-	-	-	▲0.088
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.110
6M	-	-	-	▲0.149
1Y	-	-	-	▲0.160

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

3日積みである本日の無担保コールON物は、▲0.070%の出合から始まった。その後は主に▲0.070%~▲0.060%の水準で取引された。前営業日と比較すると、ビッドサイドの資金調達ニーズは強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.007%の▲0.063%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.065	▲0.070 ~ ▲0.065	▲0.070 ~ ▲0.045

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの資金調達ニーズは強く、堅調な地合を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月2日	8月5日	8月5日	8月6日	8月6日	8月6日
券		+0	+600	+0	+0	
財政		▲87,600	▲4,900	+2,000	+2,000	
過不足		▲87,600	▲4,300	+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
国債買入			+3,200			
共通担保(全店)			▲2,400	+2,300		
CP等買入	▲100		▲200			
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+100	▲100	+100			
当座預金増減	▲87,700	▲1,400		+2,000		
当座預金残高	3,958,800	3,957,400		3,959,400		
準備預金残高	3,461,000	主な需給要因				
積み終了先	3,460,800					
超過準備	3,460,700					
非準備預金残高	497,800					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	64.5%					
乖離率	35.4%					

8月2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(8/5~)						
10~25年	1,800	5,457	1,813	▲0.037	▲0.034	13.3
25年~	400	1,724	400	▲0.036	▲0.036	
物価連動	250	1,267	251	0.080	0.055	64.8
国債補完供給(8/2~8/5)						
共通担保(全店)(8/5~8/19)			125	▲0.350	▲0.350	
	15,000	2,256	2,256			

マナタリーベース [億円]
8月1日時点 5,169,900

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,186,400
8月5日以降の残リ所要積数 1,900
平均 200

国庫短期証券入札予定

8月8日	6ヶ月	第849回
8月9日	3ヶ月	第850回
8月16日	3ヶ月	
8月19日	1年	
国債入札予定		
8月6日	30年	
8月8日	物価連動	
8月15日	5年	
8月20日	20年	

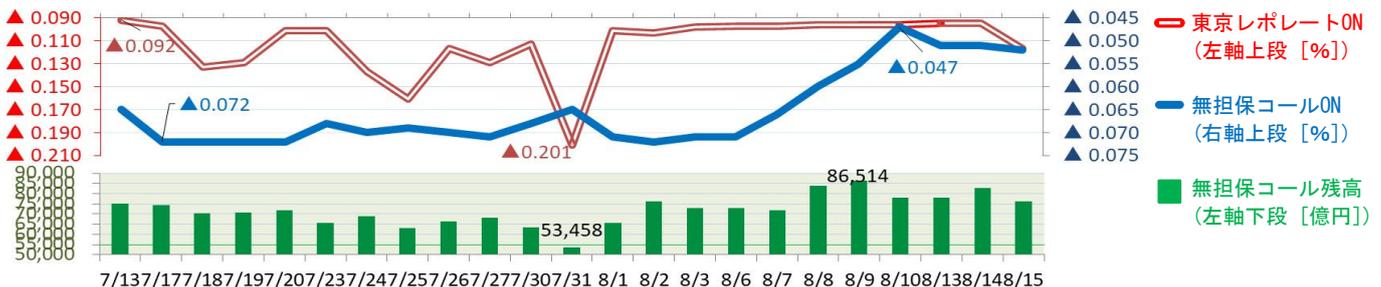
今月の国債買入オペ予定

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	7月26日	2
1年超3年以下	2,500~5,000 程度	3,800			
3年超5年以下	2,500~5,000 程度	3,800	9 19 23 30	7月31日	4
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	5 16 23 30	7月31日	4
10年超25年以下	1,000~2,500 程度	1,800			
25年超	100~1,000 程度	400	2 9 26	8月2日	2
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	8月2日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	月1回	6月14日	1

1年前の市場推移

○2018年7月積み期 [7月13日~8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。