

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年8月13日(火)

短期市場の推移

	8月6日	8月7日	8月8日	8月9日
加重平均金利	▲0.031	▲0.032	▲0.033	▲0.029
東京レポレート(ON)	▲0.038	▲0.039	▲0.044	▲0.078
無コール残	79,373	90,552	81,895	86,746
ON	46,113	57,712	52,645	56,856
その他	33,260	32,840	29,250	29,890
有コール残	18,273	19,580	18,024	17,986

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14日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:00	営業毎旬報告 (8月10日現在)	-	18:00 (欧)6月鉱工業生産指数 [前月比]	-1.0%
17:00頃	日本銀行が保有する国 債の銘柄別残高	-	18:00 (欧)4-6月期域内総生産 (GDP)改定値[前年比]	1.1%
17:00頃	日本銀行による国庫短期 証券の銘柄別買入額	-	20:00 (米)MBA住宅ローン 申請指数[前週比]	-

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	▲0.025	▲0.101
T/N	-	-	▲0.025	▲0.110
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.020	▲0.105
2W	▲0.040	▲0.005	▲0.021	▲0.105
3W	-	-	-	▲0.108
1M	-	-	-	▲0.109
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.115
6M	-	-	-	▲0.149
1Y	-	-	-	▲0.162

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、▲0.02%の出合から始まった。前営業に引き続きビッドサイドの調達意欲が強く、主に▲0.03%~▲0.020%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は▲0.025%(前営業日対比+0.004%)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.030 ~ ▲0.020	▲0.025 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

翌営業日も資金調達意欲は強く、堅調な地合を予想。

資金需給

	日銀速報 8月13日	日銀予想 8月14日	当社需給予想 8月15日
券	+200	+700	+0
財政	+3,100	▲4,200	+73,000
過不足	+3,300	▲3,500	+73,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+10,000		
共通担保(全店)	▲700	+600	
CP等買入	▲400	▲300	
社債等買入		▲100	
ETF買入		+600	+100
国債補完供給	+100	▲200	+200
当座預金増減	+13,300	▲3,600	+73,000
当座預金残高	3,975,900	3,972,300	4,045,300
準備預金残高	3,460,600	主な需給要因	
積み終了先	3,460,400		
超過準備	3,460,400		
非準備預金残高	515,300		
準備預金進捗率	99.9%		国債償還(2年) 源泉税揚げ・年 金定時払い
平均	93.5%		
乖離率	6.4%		

8月13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
米ドル資金供給(8/15~8/22)		0	0	2,630	2,630	
国債補完供給(8/13~8/14)		195	195	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
8月9日時点 5,087,000	今積期の所要準備額 3,187,400
	8月14日以降の残り所要積数 200
	平均 100

国庫短期証券入札予定

8月16日	3ヶ月	第851回
8月19日	1年	第852回
8月23日	3ヶ月	
8月30日	3ヶ月	
8月15日	5年	
8月20日	20年	
8月29日	2年	
9月3日	10年	

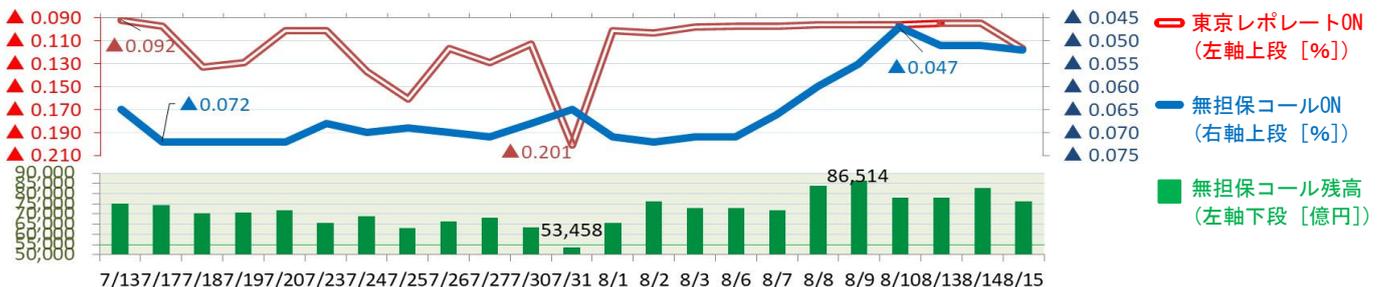
今月の国債買入オペ予定

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	100~1,000 程度	500	月2回程度	8月5日	1
1年超3年以下	2,500~5,000 程度	4,000			
3年超5年以下	2,500~5,000 程度	3,600	9 19 23 30	8月9日	3
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,800	5 16 23 30	8月5日	3
10年超25年以下	1,000~2,500 程度	1,600			
25年超	100~1,000 程度	400	2 9 26	8月9日	1
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	8月5日	0

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。