

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年8月14日(水)

## 短期市場の推移

	8月7日	8月8日	8月9日	8月13日
加重平均金利	▲0.032	▲0.033	▲0.029	▲0.025
東京レポレート(ON)	▲0.039	▲0.044	▲0.078	▲0.101
無コール残	90,552	81,895	86,746	86,286
ON	57,712	52,645	56,856	56,886
その他	32,840	29,250	29,890	29,400
有コール残	19,580	18,024	17,986	17,820

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15日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 (米)8月ニューヨーク連銀 製造業景気指数	4.5
-	-	21:30 (米)7月小売売上高	0.2%
-	-	21:30 (米)新規失業保険 申請件数[前週分]	-

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	▲0.019	▲0.102
T/N	-	-	▲0.015	▲0.104
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	▲0.015	▲0.028	▲0.104
2W	▲0.040	0.000	▲0.024	▲0.105
3W	-	-	▲0.020	▲0.108
1M	-	-	-	▲0.110
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.117
6M	-	-	-	▲0.150
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、▲0.015%の出合から始まった。前営業日に引き続きビッドサイドの調達意欲が強く、主に▲0.02%~▲0.01%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は2016年10月7日以来の▲0.019%(前営業日対比+0.006%)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.050 ~ ▲0.015	▲0.050 ~ ▲0.010

## 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14日	日銀予想 8月15日	当社需給予想 8月16日
券	+700	▲800	▲1,000
財政	▲5,300	+76,600	▲23,000
過不足	▲4,600	+75,800	▲24,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+5,000
CP等買入	▲300	▲300	
社債等買入	▲100		
ETF買入	+100		
国債補完供給	+200		
当座預金増減	▲4,700	+80,500	▲24,000
当座預金残高	3,971,200	4,051,700	4,027,700
準備預金残高	3,452,200	主な需給要因	
積み終了先	3,452,100	国債償還(2年)	
超過準備	3,452,000	源泉税揚げ・年金 定時払い	
非準備先残高	519,000	国債発行(5年)	
準備預金進捗率	100.0%		
平均	96.8%		
乖離率	3.2%		

## 8月14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
国庫短期証券買入(8/15~)	5,000	10,734	5,001	0.003	0.008	34.5
国債補完供給(8/14~8/15)			1	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [ 億円 ]  
8月13日時点 5,100,100

所要 [ 億円 ]  
今積期の所要準備額 3,187,400  
8月15日以降の残り所要  
積数 0  
平均 0

## 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	
国債入札予定		
8月15日	5年	
8月20日	20年	
8月29日	2年	
9月3日	10年	

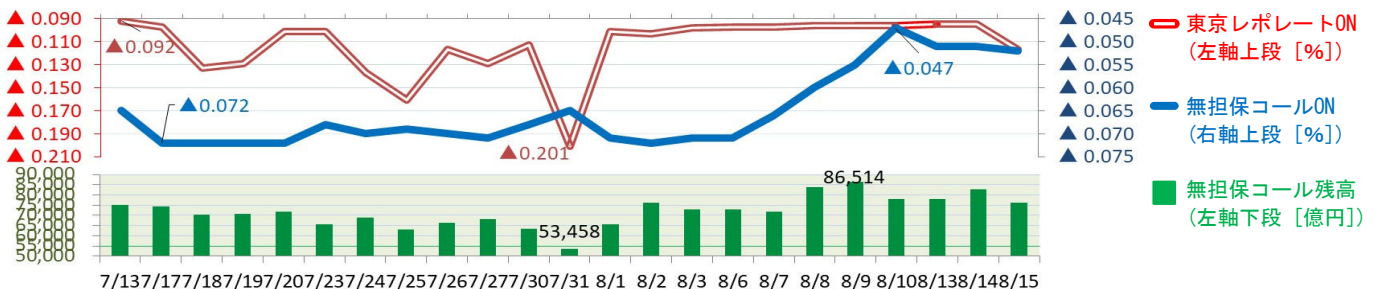
## 今月の国債買入オペ予定

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。