

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年8月15日(木)

## 短期市場の推移

	8月8日	8月9日	8月13日	8月14日
加重平均金利	▲0.033	▲0.029	▲0.025	▲0.019
東京レポレート(ON)	▲0.044	▲0.078	▲0.101	▲0.102
無コール残	81,895	86,746	86,286	93,429
ON	52,645	56,856	56,886	63,899
その他	29,250	29,890	29,400	29,530
有コール残	18,024	17,986	17,820	19,331

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16日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
17:00	業態別の日銀当座預金残高(7月)	21:30	(米)6月住宅着工件数 126.0万戸
	-	21:30	(米)6月住宅建設許可件数 127.0万戸
	-	23:00	(米)8月ミシガン大学消費者信頼感指数速報 97.1

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	▲0.020	▲0.090
T/N	-	-	-	▲0.088
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.038	▲0.093
2W	▲0.040	▲0.015	▲0.035	▲0.093
3W	-	-	0.001	▲0.097
1M	-	-	-	▲0.101
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協会公表

## 本日の市況

積み最終日となる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▲0.020%(前営業日対比▲0.001%)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.015 ~ ▲0.010	▲0.035 ~ ▲0.005

## 翌営業日のマーケット

新積み期となるため調達ニーズが弱まり、出合いの水準は低下すると予想。

## 資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	8月15日	8月16日	8月19日
券	▲700	+600	+1,000
財政	+75,700	▲22,600	▲5,000
過不足	+75,000	▲22,000	▲4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+5,000		
共通担保(全店)			▲2,300
CP等買入	▲300	▲200	
社債等買入		▲100	
ETF買入		+700	
当座預金増減	+79,700	▲21,600	▲6,300
当座預金残高	4,050,900	4,029,300	4,023,000
準備預金残高	3,516,300	主な需給要因	
積み終了先	3,516,300	国債発行(5年)	
超過準備	3,516,300	国庫短期証券発行・償還(3M)	
非準備先残高	534,600		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	100.0%		
乖離率	0.0%		

## 8月15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(8/15~8/16)		0	0			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
8月14日時点 5,094,600	来積期の所要準備額 3,179,400
	8月16日以降の残り所要積数 3,179,400
	平均 102,600

## 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20日	20年	
8月29日	2年	
9月3日	10年	
9月5日	30年	

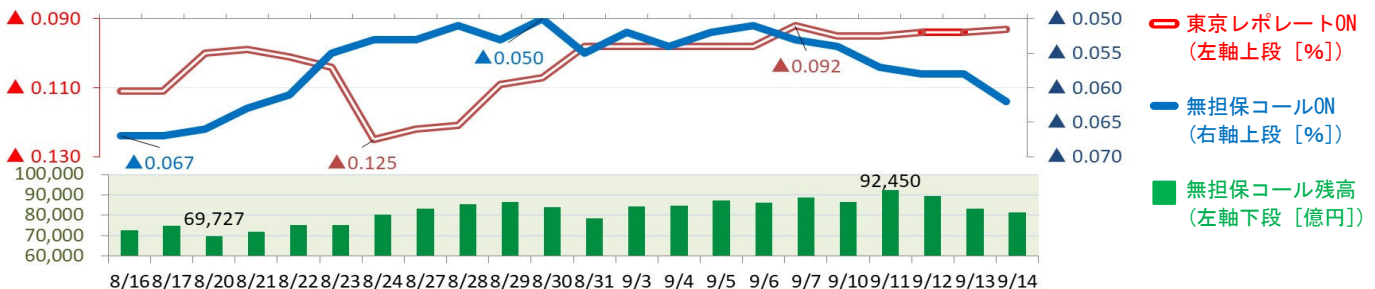
## 今月の国債買入オペ予定

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8月積み期 [8月16日~9月14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。