

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年8月19日(月)

## 短期市場の推移

	8月13日	8月14日	8月15日	8月16日
加重平均金利	▲0.025	▲0.019	▲0.020	▲0.057
東京レポレート(ON)	▲0.101	▲0.102	▲0.090	▲0.085
無コール残	86,286	93,429	93,833	91,547
ON	56,886	63,899	64,253	60,767
その他	29,400	29,530	29,580	30,780
有コール残	17,820	19,331	17,786	20,163

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
9:00	公社債店頭売買高(7月)		-	
16:00	コンビニ売上高(7月)		-	
			-	

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	▲0.060	▲0.084
T/N	-	-	-	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.088
2W	-	-	▲0.040	▲0.093
3W	▲0.040	0.000	▲0.027	▲0.096
1M	-	-	▲0.040	▲0.101
2M	-	-	0.001	-
3M	-	-	-	▲0.120
6M	-	-	-	▲0.151
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、▲0.065%の出来から始まりその後は、主に▲0.075%~▲0.05%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は▲0.060%(前営業日対比▲0.003%)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.070	▲0.065 ~ ▲0.055	▲0.070 ~ ▲0.050

## 翌営業日のマーケット

調達サイドの動向に大きな変化はなく、地合は横ばいを予想する。

## 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	+900	+400	+0
財政	▲4,400	▲12,800	▲11,000
過不足	▲3,500	▲12,400	▲11,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+4,700	+7,700	スタート
共通担保(全店)	▲2,300	+2,300	
CP等買入	▲200	▲300	
ETF買入	+100	+700	
国債補完供給	▲100	+100	
当座預金増減	+1,000	▲4,200	▲11,000
当座預金残高	4,032,100	4,027,900	4,016,900
準備預金残高	3,503,500	主な需給要因	
積み終了先	3,483,800	国庫短期証券 発行・償還(1Y)	
超過準備	3,475,300	国債発行 (20年)	
非準備先残高	528,600		
準備預金進捗率	99.0%		
平均	12.9%		
乖離率	86.1%		

## 8月19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(8/20~)						
1~3年	4,000	9,021	4,002	0.001	0.004	65.9
3~5年	3,600	7,421	3,604	0.001	0.002	93.9
国債補完供給(8/19~8/20)						
		52	52	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]  
8月16日時点 5,154,400

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,179,400  
8月20日以降の残り所要積数 32,500  
平均 1,200

## 国庫短期証券入札予定

8月23日	3ヶ月	第853回
8月30日	3ヶ月	
9月6日	3ヶ月	
9月9日	6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	

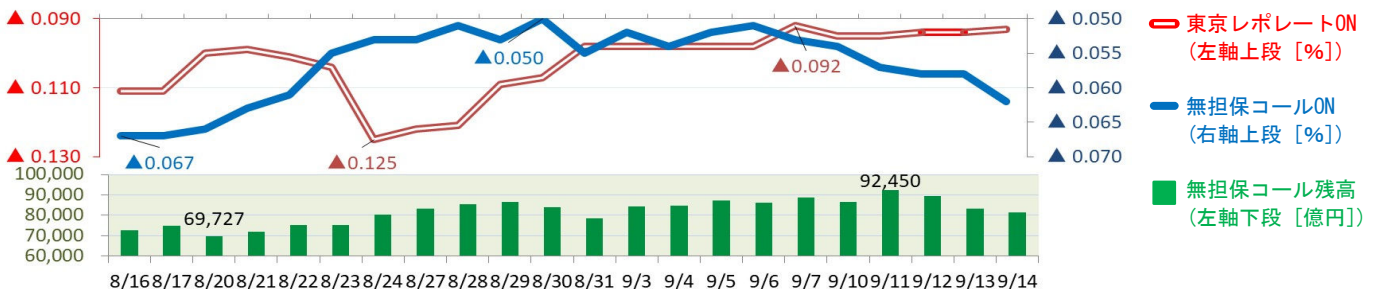
## 今月の国債買入オペ予定

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19日	2
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,500	5 16 23 30	8月16日	2
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。