

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年8月20日(火)

短期市場の推移

[億円] [%]

	8月14日	8月15日	8月16日	8月19日
加重平均金利	▲0.019	▲0.020	▲0.057	▲0.061
東京レポレート(ON)	▲0.102	▲0.090	▲0.085	▲0.084
無コール残	93,429	93,833	91,547	90,233
ON	63,899	64,253	60,767	58,683
その他	29,530	29,580	30,780	31,550
有コール残	19,331	17,786	20,163	21,640

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21日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
特になし		20:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]
-		23:00	(米)7月中古住宅販売件数
-		-	7月FOMC議事録

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

本日の市況

	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	▲0.059	▲0.080
T/N	-	-	-	▲0.083
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.230	▲0.020	▲0.088
2W	-	-	-	▲0.090
3W	-	-	-	▲0.094
1M	-	-	-	▲0.100
2M	-	-	-	-
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協会公表

本日の無担保コールON物は、▲0.060%の合出から始まった。その後は、主に▲0.070%~▲0.045%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は▲0.059%(前営業日対比+0.002%)となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.060 ~ ▲0.055	▲0.065 ~ ▲0.045

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、出合いの水準は横ばいと予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月20日	8月21日	8月21日	8月22日	8月22日	8月23日
券		+500		+100		+0
財政		▲13,200		▲11,500		+1,000
過不足		▲12,700		▲11,400		+1,000
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		+7,700				
CP等買入	▲300		▲300			
ETF買入		+700		+100		
国債補完供給	+100					
当座預金増減		▲4,500		▲11,600		+1,000
当座預金残高		4,027,600		4,016,000		4,017,000
準備預金残高		3,478,100	主な需給要因			
積み終了先		3,470,400				
超過準備		3,460,600				
非準備先残高		549,500				
準備預金進捗率		99.5%				
平均		16.1%				
乖離率		83.4%				

8月20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(8/22~8/29)		3	3	2,640	2,640	
社債等買入(8/26~)	1,250	2,756	1,250	▲0.083	▲0.073	61.2
国債補完供給(8/20~8/21)		0	0			
	1	1	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
8月19日時点 5,154,400	今積期の所要準備額 3,179,400
	8月21日以降の残り所要積数 15,000
	平均 600

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	
8月29日	2年	
9月3日	10年	
9月5日	30年	
9月11日	5年	

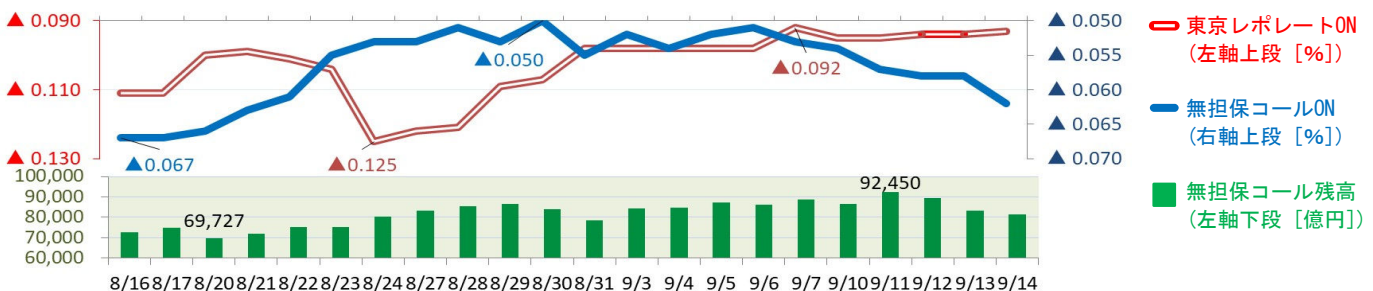
今月の国債買入オペ予定

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。