

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年8月23日(金)

短期市場の推移

	8月19日	8月20日	8月21日	8月22日
加重平均金利	▲0.061	▲0.059	▲0.058	▲0.058
東京レポレート(ON)	▲0.084	▲0.080	▲0.085	▲0.078
無コール残	90,233	88,403	87,411	95,078
ON	58,683	56,773	54,191	61,333
その他	31,550	31,630	33,220	33,745
有コール残	21,640	22,042	19,590	22,067

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26日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
14:00	6月の景気動向 指数改訂値(内閣府)	17:00	(独)8月IFO企業 景況感指数 96.0
		21:30	(米)7月耐久財 受注[前月比] 1.1%
		21:30	(米)7月シカゴ連銀 全米活動指数 -

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	▲0.052	▲0.080
T/N	-	-	-	▲0.082
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	0.250	▲0.039	▲0.086
2W	-	-	▲0.035	▲0.087
3W	▲0.040	▲0.035	▲0.038	▲0.093
1M	-	-	-	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	▲0.030	▲0.121
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.163

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、▲0.055%の出合から始まった。その後は、主に▲0.070%~▲0.045%の水準で取引された。週末3日積み要因でビッドサイドの調達意欲が強まり、同加重平均金利(速報)は▲0.052%(前営業日対比+0.006%)に上昇した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.050 ~ ▲0.045	▲0.070 ~ ▲0.045

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達スタンスに大きな変化はなく、横ばいでの出合水準を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月23日	8月26日	8月26日	8月27日	8月27日	8月27日
券		▲500		+600		+0
財政		+700		+3,500		+1,000
過不足		+200		+4,100		+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				+12,600		
共通担保(全店)			▲600	+900		
CP等買入	▲400		▲500			
社債等買入				+1,300		
ETF買入		+700		+700		
被災地金融機関支援	▲900	+900				
国債補充供給	+400					
当座預金増減		+900		+18,500		+1,000
当座預金残高		4,017,700		4,036,200		4,037,200
準備預金残高		3,496,900				
積み終了先		3,496,200				
超過準備		3,496,100				
非準備先残高		520,800				
準備預金進捗率		99.8%				
平均		32.3%				
乖離率		67.5%				

8月23日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(8/26~)						
1~3年	4,000	15,760	4,006	0.008	0.010	33.4
3~5年	3,600	9,940	3,602	0.005	0.006	79.3
5~10年	4,500	8,451	4,502	0.000	0.006	12.4
国債補充供給(8/23~8/26)						
共通担保(全店)			9	▲0.350	▲0.350	
			17	▲0.350	▲0.350	
共通担保(全店)(8/26~9/9)			15,000	937	937	

マナタリーベース [億円]
8月22日時点 5,139,700

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,179,400
8月26日以降の残り所要
積数 7,000
平均 300

国庫短期証券入札予定

8月30日	3ヶ月	第854回
9月6日	3ヶ月	
9月9日	6ヶ月	
9月13日	3ヶ月	
国債入札予定		
8月29日	2年	
9月3日	10年	
9月5日	30年	
9月11日	5年	

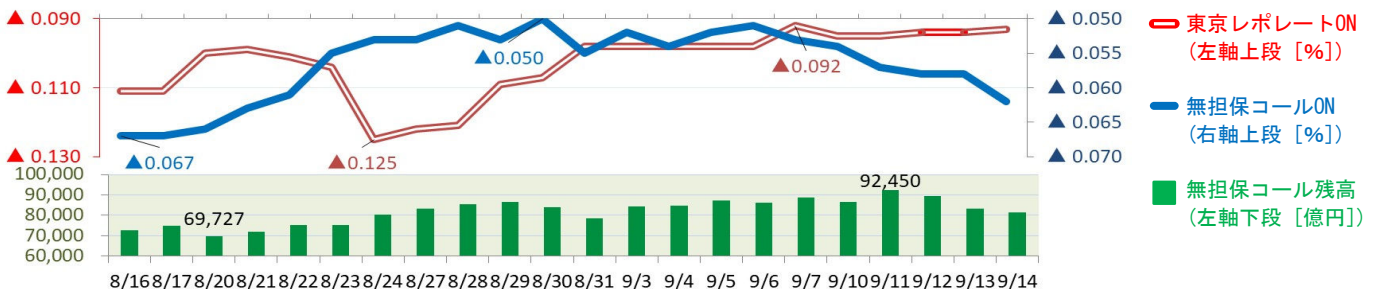
今月の国債買入オペ予定

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23日	1
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,500	5 16 23 30	8月23日	1
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。