

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年8月8日(水)

短期市場の推移

	8月2日	8月3日	8月6日	8月7日
加重平均金利	▲0.072	▲0.071	▲0.071	▲0.066
東京レポレート(ON)	▲0.103	▲0.098	▲0.097	▲0.097
無コール残	76,216	72,826	72,742	71,689
ON	47,361	43,911	43,677	44,274
その他	28,855	28,915	29,065	27,415
有コール残	22,423	27,070	26,818	23,751

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9日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	6月機械受注[前月比]	▲0.9%	21:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分]
8:50	マネーストック(7月)	-	21:30	(米)7月生産者物価コア指数[前年比]
8:50	貸出先別貸出金(四半期調査)(3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	▲0.086	0.001	▲0.060	▲0.096
T/N	-	-	0.000	▲0.111
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	0.001	▲0.024	▲0.110
2W	▲0.028	▲0.025	▲0.027	▲0.112
3W	-	-	-	▲0.114
1M	-	-	0.000	▲0.120
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.132
6M	-	-	-	▲0.146
1Y	-	-	-	▲0.154

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

無担保コールON物は▲0.075%の出合から始まった。その後は主に▲0.075~▲0.025%の水準で取引される堅調な地合いとなった。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比+0.006%の▲0.060%となった。

O/N業態別出合レンジ

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.070	▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.075 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

引続き調達サイドの厚みが増すと思われるため、堅調な地合いが継続すると予想する。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	8月8日	8月9日	8月10日
券	+300	▲500	▲1,000
財政	▲7,100	▲2,300	▲12,000
過不足	▲6,800	▲2,800	▲13,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+9,800
CP等買入	▲200	▲200	
国債補完供給	+2,600	+1,500	+2,000
当座預金増減	▲5,900	+8,300	▲11,000
当座預金残高	3,846,100	3,854,400	3,843,400
準備預金残高	3,373,900	主な需給要因	
積み終了先	3,373,700	国庫短期証券発行・償還(6M)	
超過準備	3,373,700	国債発行(30年)	
非準備預金残高	472,200		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	77.4%		
乖離率	22.5%		

8月8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(8/9~)						
1~3年	2,500	9,398	2,506	0.003	0.003	80.6
3~5年	3,000	8,233	3,006	0.002	0.003	42.9
5~10年	4,000	12,815	4,003	▲0.003	0.000	6.9
物価連動	250	1,359	251	▲0.060	▲0.092	54.9
国債補完供給(8/8~8/9)						
	41,897	1,506	1,506	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]
8月7日時点 4,945,600

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,136,200
8月9日以降の残り所要積数 1,000
平均 100

国庫短期証券入札予定

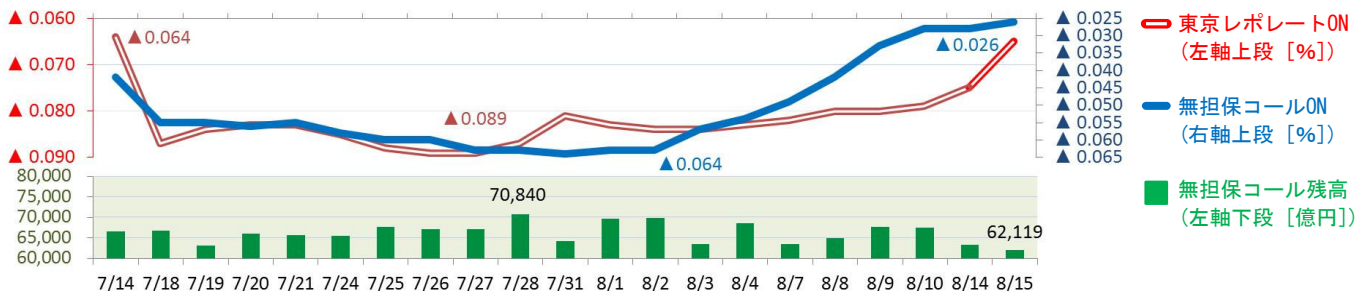
8月9日	6ヶ月	第775回
8月10日	3ヶ月	第776回
8月16日	1年	
8月17日	3ヶ月	
国債入札予定		
8月9日	30年	
8月16日	5年	
8月21日	20年	
8月30日	2年	

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1日	1
1年超3年以下	2,000~3,000 程度	2,500			
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,000			
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,000			
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	500~1,500 程度	600			
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	8月8日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	6月8日	1

1年前の市場推移

○2017年7月積み期 [7月14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。