

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年8月10日(金)

短期市場の推移

	8月6日	8月7日	8月8日	8月9日
加重平均金利	▲0.071	▲0.066	▲0.060	▲0.055
東京レポレート(ON)	▲0.097	▲0.097	▲0.096	▲0.096
無コール残	72,742	71,689	83,815	86,514
ON	43,677	44,274	55,520	60,769
その他	29,065	27,415	28,295	25,745
有コール残	26,818	23,751	24,985	21,143

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13日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
	-		-	
	-		-	
	-		-	

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	▲0.047	▲0.096
T/N	-	-	0.000	▲0.101
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	0.001	▲0.024	▲0.108
2W	-	-	-	▲0.111
3W	-	-	-	▲0.114
1M	-	-	0.050	▲0.120
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.131
6M	-	-	-	▲0.146
1Y	-	-	-	▲0.155

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

週末3日積みとなる無担保コールON物は▲0.065%の出合から始まった。その後は主に▲0.070~▲0.020%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+0.008%の▲0.047%となった。

O/N業態別出合レンジ

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.065	▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.065 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

引き続き調達ニーズは強く、地銀業態を中心に堅調な地合いになると予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月10日		8月13日		8月14日	
券		▲300		+200		+1,000
財政		▲10,000		▲8,300		▲8,000
過不足		▲10,300		▲8,100		▲7,000
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				+8,400		
共通担保(全店)			▲2,600	+2,200		
CP等買入	▲200	+2,000	▲200			
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+1,100	▲1,900	+1,900			
当座預金増減		▲9,400		+1,600		▲7,000
当座預金残高		3,844,300		3,845,900		3,838,900
準備預金残高		3,377,500				
積み終了先		3,377,300				
超過準備		3,377,300				
非準預先残高		466,800				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		90.3%				
乖離率		9.6%				

8月10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(8/13~)						
1~3年	2,500	8,211	2,503	0.000	0.001	84.2
3~5年	3,000	9,699	3,009	▲0.004	▲0.004	86.2
10~25年	1,800	6,983	1,815	▲0.012	▲0.011	98.0
25年~	600	1,937	606	▲0.019	▲0.018	47.8
国債補完供給(8/10~8/13)						
97.441	1,797	1,797	▲0.600	▲0.751		
19.960	70	70	▲0.600	▲0.600		
共通担保(全店)(8/13~8/27)						
8,000	2,154	2,154				

マナタリーベース [億円]
8月9日時点 4,947,400

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,136,200
8月13日以降の残り所要積数 400
平均 100

国庫短期証券入札予定

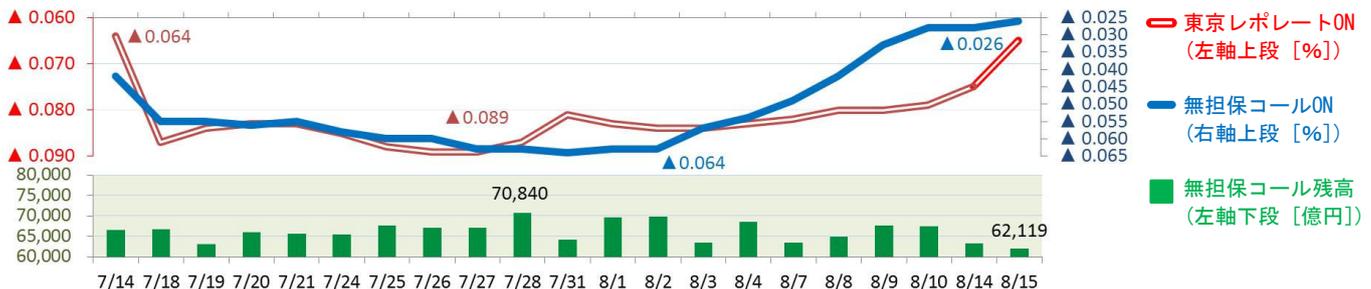
8月16日	1年	第777回
8月17日	3ヶ月	第778回
8月24日	3ヶ月	
8月31日	3ヶ月	
8月16日	5年	
8月21日	20年	
8月30日	2年	
9月5日	10年	

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			
物価運動債	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。