

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年8月14日(火)

## 短期市場の推移

[億円] [%]

	8月8日	8月9日	8月10日	8月13日
加重平均金利	▲0.060	▲0.055	▲0.047	▲0.051
東京レポレート(ON)	▲0.096	▲0.096	▲0.096	▲0.095
無コール残	83,815	86,514	77,848	78,123
ON	55,520	60,769	52,053	51,978
その他	28,295	25,745	25,795	26,145
有コール残	24,985	21,143	22,718	24,364

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15日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	20:00 (米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]	-
-	-	21:30 (米)8月NY連銀製造業景気指数	20.3
-	-	21:30 (米)7月小売売上高	0.2%

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	▲0.085	0.001	▲0.051	▲0.095
T/N	▲0.035	0.000	▲0.018	▲0.099
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.001	▲0.025	▲0.109
2W	▲0.050	▲0.028	▲0.042	▲0.113
3W	▲0.040	▲0.010	▲0.036	▲0.116
1M	-	-	-	▲0.121
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.133
6M	-	-	-	▲0.146
1Y	-	-	-	▲0.156

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

無担保コールON物は▲0.065%の出合から始まり、その後は昨日と同様、▲0.070~▲0.015%の広いレンジで取引された。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比横ばいの▲0.051%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.065	▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.065 ~ ▲0.015

## 翌営業日のマーケット

積み最終日となる明日は、引き続き地銀業態を中心に堅調な地合になると予想する。

## 資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	8月14日	8月15日	8月16日
券	▲200	+0	+0
財政	▲5,700	+82,600	+1,000
過不足	▲5,900	+82,600	+1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+5,000		
CP等買入	▲300	▲300	
社債等買入		▲100	
ETF買入	+700		
国債補完供給	+3,000	+2,700	
当座預金増減	▲200	+84,900	+1,000
当座預金残高	3,843,700	3,928,600	3,929,600
準備預金残高	3,365,000	主な需給要因	
積み終了先	3,364,900	年金定時払い 国債償還(2年)	
超過準備	3,364,900		
非準備預金残高	478,700		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	96.8%		
乖離率	3.1%		

## 8月14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(8/16~8/23)		1	1	2,410	2,410	
CP等買入(8/17~)	2,000	6,431	1,941	▲0.001	▲0.001	80.4
国債補完供給(8/14~8/15)	93,723	2,605	2,605	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
8月13日時点 4,937,900	今積期の所要準備額 3,136,200
	8月15日以降の残り所要積数 200
	平均 200

## 国庫短期証券入札予定

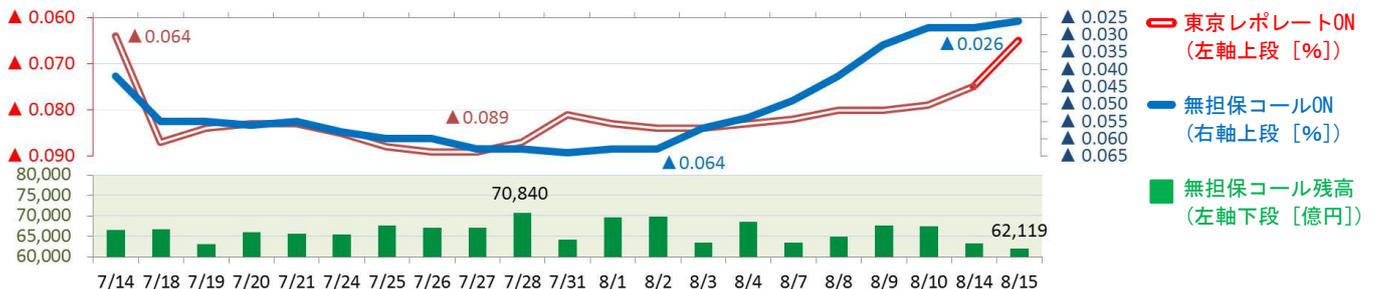
8月16日	1年	第777回
8月17日	3ヶ月	第778回
8月24日	3ヶ月	
8月31日	3ヶ月	
8月16日	5年	
8月21日	20年	
8月30日	2年	
9月5日	10年	

## 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	1 8 10 17 24 31	8月10日	3
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,000	3 8 15 22 24 31	8月8日	4
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	500~1,500 程度	600	3 10 15 22 29	8月10日	3
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。