

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年8月15日(水)

短期市場の推移

[億円] [%]

	8月9日	8月10日	8月13日	8月14日
加重平均金利	▲0.055	▲0.047	▲0.051	▲0.051
東京レポレート(ON)	▲0.096	▲0.096	▲0.095	▲0.095
無コール残	86,514	77,848	78,123	82,668
ON	60,769	52,053	51,978	56,313
その他	25,745	25,795	26,145	26,355
有コール残	21,143	22,718	24,364	23,060

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16日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
17:00	業態別の日銀当座 預金残高(7月)	-	21:30	(米)新規失業保険 申請件数[前週分]
	-		21:30	(米)7月住宅着工件数
	-			127.3万戸

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	▲0.052	▲0.117
T/N	-	-	0.000	▲0.145
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.030	▲0.041	▲0.134
2W	▲0.050	▲0.030	▲0.040	▲0.132
3W	-	-	▲0.045	▲0.134
1M	-	-	-	▲0.133
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.139
6M	-	-	-	▲0.147
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

本日の市況

積み最終日となる本日の無担保コールON物は、▲0.065%の出合から始まった。その後は昨日と同様、▲0.075~▲0.015%の幅広いレンジで取引された。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比ほぼ横ばいの▲0.052%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.070	▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.070 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

積み初日となる翌営業日は、ビッドサイドが慎重な調達姿勢となることから、軟調な地合が予想される。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	8月15日	8月16日	8月16日	8月17日	8月17日
券		+100	▲400		+0
財政		+82,100	▲400		▲16,000
過不足		+82,200	▲800		▲16,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入				+6,700	
CP等買入	▲300				+1,900
社債等買入	▲100				
国債補充供給	+2,700	▲2,400	+2,400		
当座預金増減		+82,100	+8,300		▲14,100
当座預金残高		3,925,800	3,934,100		3,920,000
準備預金残高		3,445,800			主な需給要因
積み終了先		3,445,800			
超過準備		3,445,600			
非準備預金残高		480,000			
準備預金進捗率		100.0%			国債発行(5年)
平均		100.0%			
乖離率		0.0%			

8月15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(8/16~)						
5~10年	4,000	11,175	4,017	▲0.004	▲0.003	31.3
10~25年	1,800	6,043	1,809	0.003	0.005	3.7
25年~	600	2,299	605	0.003	0.004	89.3
国債補充供給(8/15~8/16)						
60,108	2,382	2,382	▲0.600	▲0.600		
10,000	4	4	▲0.600	▲0.600		

マナタリーベース [億円]
8月14日時点 4,937,900

所要 [億円]
来積期の所要準備額 3,120,700
8月16日以降の残り所要
積数 3,120,700
平均 100,700

国庫短期証券入札予定

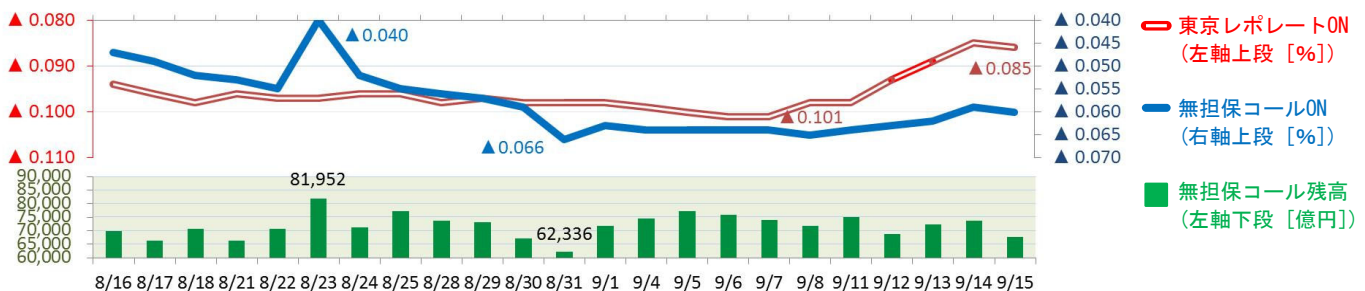
8月16日	1年	第777回
8月17日	3ヶ月	第778回
8月24日	3ヶ月	
8月31日	3ヶ月	
国債入札予定		
8月16日	5年	
8月21日	20年	
8月30日	2年	
9月5日	10年	

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	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15日	3
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15日	2
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8月積み期 [8月16日~9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。

上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会