

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年8月27日(木)

## 短期市場の推移

	8月21日	8月24日	8月25日	8月26日
加重平均金利	▲0.037	▲0.041	▲0.048	▲0.051
東京レポレート(ON)	▲0.071	▲0.069	▲0.069	▲0.076
無コール残	95,007	93,708	95,693	92,953
ON	64,959	61,280	62,515	59,475
その他	30,048	32,428	33,178	33,478
有コール残	18,174	19,328	18,748	18,589

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28日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	8月中旬の東京都区部消費者物価(総務省)		21:30	(米)7月個人消費支出(PCE)価格コア指数[前年比] 1.2%
8:50	8月上旬の貿易統計(財務省)			8月のシカゴPMI
				8月のミシガン大消費者信頼感指数(確報)

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	▲0.054	▲0.077
T/N	-	-	▲0.001	▲0.084
S/N	▲0.120	▲0.080	▲0.106	-
1W	▲0.045	▲0.020	▲0.033	▲0.080
2W	-	-	-	▲0.078
3W	-	-	▲0.005	▲0.079
1M	-	-	-	▲0.086
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.092
6M	-	-	-	▲0.136
1Y	-	-	-	▲0.167

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▲0.045%の出合から始まり、その後は▲0.080%~▲0.030%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は4営業日連続で低下し、前営業日対比▲0.003%の▲0.054%となった。27日の日銀当座預金残高は過去最高の460兆円台になる見込み。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.070	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.070 ~ ▲0.030

## 翌営業日のマーケット

週末3日積みとなるが引き続き地銀の出合が中心となり、出合水準は横ばい圏の見込み。

## 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月27日	8月28日	8月27日	8月28日	8月31日	8月31日
券	▲800	▲300	▲800	▲300	▲500	▲500
財政	+1,400	+5,600	+1,400	+5,600	+2,000	+2,000
過不足	+600	+5,300	+600	+5,300	+1,500	+1,500
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
国庫短期証券買入		+30,000				
国債買入		+12,200				
CP等買入	▲300		▲400	+6,000		
社債等買入	▲200					
ETF買入		+400		+500		
米ドル資金供給用担保国債供給		+1,000				
新型コロナ対応金融支援特別貸出増加支援	▲17,300	+133,500				
貸出増加支援	▲100					
当座預金増減	+158,800	+12,400	+158,800	+12,400	+1,500	+1,500
当座預金残高	4,635,700	4,648,100	4,635,700	4,648,100	4,649,600	4,649,600
準備預金残高	4,029,800		4,029,800			
積み終了先	4,029,500		4,029,500			
超過準備	4,028,900		4,028,900			
非準備先残高	605,900		605,900			
準備預金進捗率	99.9%		99.9%			
平均	38.7%		38.7%			
乖離率	61.2%		61.2%			

## 8月27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(8/31~9/8)	0	0	0	0.340	0.340	
国債補完供給(8/27~8/28)	7	7	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]  
8月26日時点 5,662,400

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,499,200  
8月28日以降の残り所要積数 2,200  
平均 100

## 国庫短期証券入札予定

8月28日	3ヶ月	第933回
9月4日	3ヶ月	
9月9日	6ヶ月	
9月11日	3ヶ月	
9月1日	10年	
9月3日	30年	
9月8日	5年	
9月10日	20年	

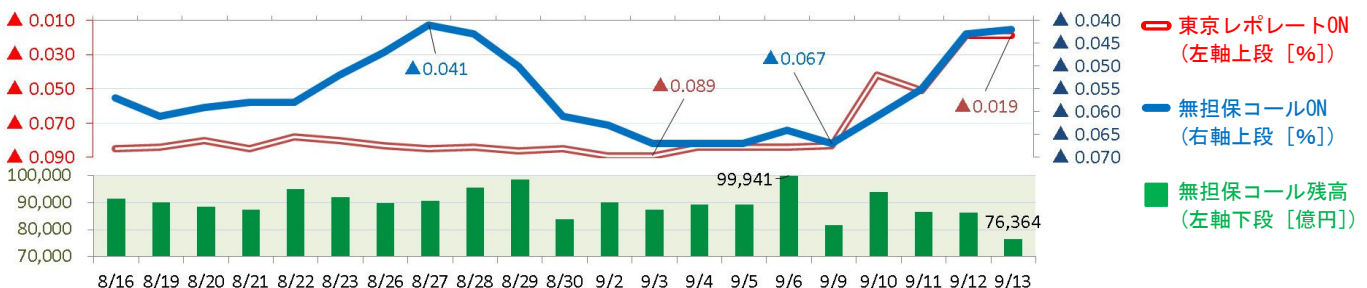
## 今月の国債買入オペ予定

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	500~1,500	1,000	月3回程度	8月24日	1
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	3 7 13 21 26 31	8月26日	1
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	5 13 19 24 26 31	8月26日	1
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	7 13 19 21 26	8月26日	0
10年超25年以下	500~2,000	1,200	5 28	8月5日	1
25年超	0~500	300	21 28	8月21日	1
物価連動債	300	300	月2回程度	8月3日	1
変動利付債<偶数月>	1,000	1,000	月1回	8月5日	-

## 1年前の市場推移

○2019年8月積み期 [8月16日~9月13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