

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年8月28日(金)

## 短期市場の推移

[億円] [%]

	8月24日	8月25日	8月26日	8月27日
加重平均金利	▲0.041	▲0.048	▲0.051	▲0.054
東京レポレート(ON)	▲0.069	▲0.069	▲0.076	▲0.077
無コール残	93,708	95,693	92,953	92,894
ON	61,280	62,515	59,475	58,761
その他	32,428	33,178	33,478	34,133
有コール残	19,328	18,748	18,589	19,141

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31日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	7月鉱工業生産指数 [前月比]	+5.0%	-	ダラス連銀製造業 活動指数(8月)
	-	-	-	FRB副議長、講演
	-	-	-	アトランタ連銀総裁、講演

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	▲0.080
T/N	-	-	▲0.001	▲0.079
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.045	▲0.078
2W	-	-	▲0.035	▲0.077
3W	-	-	-	▲0.080
1M	▲0.040	▲0.020	▲0.027	▲0.083
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.092
6M	-	-	-	▲0.137
1Y	-	-	-	▲0.166

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)は前営業日対比横ばいの▲0.054%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.070	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.060 ~ ▲0.030

## 翌営業日のマーケット

引き続き地銀中心の出合となり、出合水準は概ね横ばいを予想。

## 資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月28日		8月31日		9月1日	
券	▲300		+400		+1,000	
財政	+5,900		+4,200		▲26,000	
過不足	+5,600		+4,600		▲25,000	
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	-	-	-	+2,100	-	-
CP等買入	▲400	+6,000	▲2,900	-	-	-
ETF買入	-	+500	-	-	-	-
米ドル資金供給用担保国債供給	+1,000	-	-	-	-	-
当座預金増減	+12,700		+3,800		▲25,000	
当座預金残高	4,648,400		4,652,200		4,627,200	
準備預金残高	4,025,200		-		-	
積み終了先	4,024,700		-		-	
超過準備	4,024,700		-		-	
非準備預金残高	623,200		-		-	
準備預金進捗率	99.9%		-		-	
平均	48.4%		-		-	
乖離率	51.5%		-		-	

## 8月28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(8/31~)						
10~25年	1,200	2,689	1,206	0.018	0.020	15.0
25年~	300	1,537	303	0.026	0.027	31.8
物価連動	300	1,854	301	▲0.100	▲0.139	36.0
米ドル資金供給(9/1~9/8)						
			0	0	0.340	0.340
国債補完供給(8/28~8/31)						
			0	0		
			5	5	▲0.350	▲0.350

マナタリーベース [億円]  
8月27日時点 5,822,000

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,499,200  
8月31日以降の残り所要  
積数 900  
平均 100

## 国庫短期証券入札予定

9月4日	3ヶ月	第934回
9月9日	6ヶ月	
9月11日	3ヶ月	
9月16日	1年	
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28日	0
25年超	0~500	300	21 28	8月28日	0
物価連動債	300	300	月2回程度	8月28日	0
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