

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年8月27日(火)

短期市場の推移

[億円][%]

	8月21日	8月22日	8月23日	8月26日
加重平均金利	▲0.058	▲0.058	▲0.052	▲0.047
東京レポレート(ON)	▲0.085	▲0.078	▲0.080	▲0.083
無コール残	87,411	95,078	91,899	89,884
ON	54,191	61,333	57,854	55,419
その他	33,220	33,745	34,045	34,465
有コール残	19,590	22,067	20,306	20,193

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
特になし		20:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]
-		-	-
-		-	-

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	▲0.075	0.001	▲0.041	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.090
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.000	▲0.029	▲0.091
2W	▲0.040	0.000	▲0.024	▲0.092
3W	-	-	0.000	▲0.097
1M	-	-	-	▲0.104
2M	-	-	0.000	-
3M	-	-	-	▲0.125
6M	-	-	-	▲0.153
1Y	-	-	-	▲0.164

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%の出合から始まった。その後は、主に▲0.045%~▲0.035%の水準で取引された。調達意欲は前営業日と同様に堅調で、同加重平均金利(速報)は▲0.041%(前営業日対比+0.006%)に上昇した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.045	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.045 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

堅調な調達ニーズは継続し、出合の水準は小幅上昇と予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月27日	8月28日	8月27日	8月28日	8月29日	8月29日
券	+100	+0	+100	+0	+100	+0
財政	+900	▲7,800	+900	▲7,800	+1,000	+1,000
過不足	+1,000	▲7,800	+1,000	▲7,800	+1,000	+1,000
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
国庫短期証券買入				+2,500		
国債買入		+2,700				
CP等買入	▲200		▲400			
ETF買入		+600		+100		
当座預金増減	+4,100	▲5,600	+4,100	▲5,600	+1,000	+1,000
当座預金残高	4,041,600	4,036,000	4,041,600	4,036,000	4,037,000	4,037,000
準備預金残高	3,514,300	主な需給要因				
積み終了先	3,513,600					
超過準備	3,513,600					
非準備預金残高	527,300					
準備預金進捗率	99.8%					
平均	38.7%					
乖離率	61.1%					

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
国庫短期証券買入(8/28~)	2,500	8,242	2,502	0.008	0.009	59.6
米ドル資金供給(8/29~9/6)			0	2.630	2.630	
CP等買入(8/30~)	3,000	7,955	2,981	▲0.001	0.002	45.7
国債補完供給(8/27~8/28)	34	34	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [億円]
8月26日時点 5,160,400

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,179,400
8月28日以降の残り所要積数 5,600
平均 300

国庫短期証券入札予定

8月30日	3ヶ月	第854回
9月6日	3ヶ月	
9月9日	6ヶ月	
9月13日	3ヶ月	
国債入札予定		
8月29日	2年	
9月3日	10年	
9月5日	30年	
9月11日	5年	

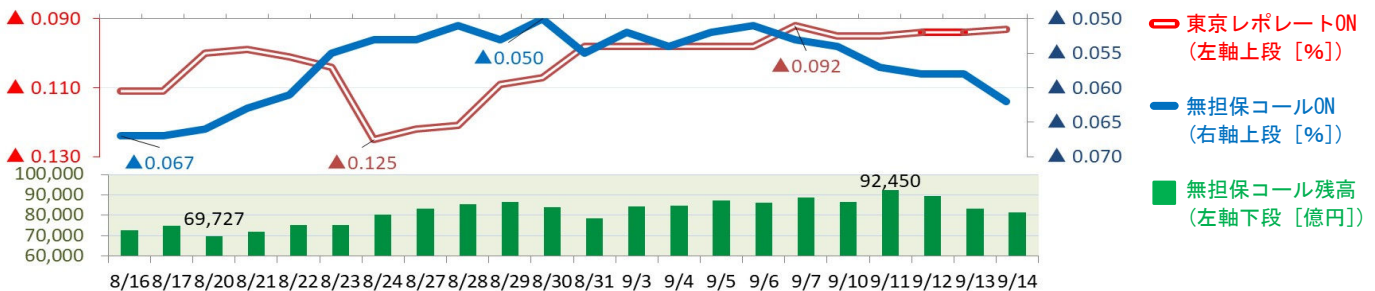
今月の国債買入オペ予定

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5日	1
1年超3年以下	2,500~5,000 程度	4,000			
3年超5年以下	2,500~5,000 程度	3,600	9 19 23 30	8月23日	1
5年超10年以下	3,000~6,500 程度	4,500	5 16 23 30	8月23日	1
10年超25年以下	1,000~2,500 程度	1,600			
25年超	100~1,000 程度	400	2 9 26	8月26日	0
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	8月26日	0
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	月1回	8月5日	-

1年前の市場推移

○2018年8月積み期 [8月16日~9月14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。