

短期市場の推移

	8月22日	8月23日	8月26日	8月27日
加重平均金利	▲0.058	▲0.052	▲0.047	▲0.041
東京レポレート(ON)	▲0.078	▲0.080	▲0.083	▲0.085
無コール残	95,078	91,899	89,884	90,565
ON	61,333	57,854	55,419	55,620
その他	33,745	34,045	34,465	34,945
有コール残	22,067	20,306	20,193	19,692

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。無コール残は無担保・有担保コール残高の意。

8月29日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
10:30 【挨拶】鈴木日銀審議委員(熊本)		21:30 (米)4-6月期国内総生産(GDP)改定値[前期比年率]	2.0%
消費動向調査(内閣府)	-	21:30 (米)新規失業保険申請件数(前週分)	-

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	▲0.043	▲0.084
T/N	-	-	0.001	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.000	▲0.037	▲0.090
2W	▲0.035	▲0.018	▲0.021	▲0.091
3W	-	-	-	▲0.097
1M	0.015	0.030	0.024	▲0.106
2M	-	-	-	-
3M	-	-	▲0.033	▲0.126
6M	-	-	-	▲0.153
1Y	-	-	-	▲0.165

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、▲0.040%の出合から始まった。その後は、主に▲0.060%~▲0.035%の水準で取引された。昨日から一転してビッドサイドの様子見姿勢が強くなり、同加重平均金利(速報)は▲0.043%(前営業日対比▲0.002%)に低下した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.040	▲0.040 ~ ▲0.035	▲0.050 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

本日対比で地合は弱含むと予想する。

資金需給

	日銀速報 8月28日	日銀予想 8月29日	当社需給予想 8月30日
券	+0	▲600	▲800
財政	▲7,200	▲300	+2,000
過不足	▲7,200	▲900	+1,200
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+2,500	
CP等買入	▲400	▲300	
ETF買入	+100	+600	
国債補完供給	▲200	+200	+3,000
当座預金増減	▲5,200	▲400	+4,200
当座預金残高	4,036,400	4,036,000	4,040,200
準備預金残高	3,510,200	主な需給要因	
積み終了先	3,509,500		
超過準備	3,509,500		
非準備先残高	526,200		
準備預金進捗率	99.8%		
平均	41.9%		
乖離率	57.9%		

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
国債補完供給(8/28~8/29)						
	124	124	▲0.350	▲0.350		
	37	37	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [億円]
8月27日時点 5,164,500

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,179,400
8月29日以降の残り所要積数 4,900
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。 上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会