

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年8月29日(木)

## 短期市場の推移

[億円] [%]

	8月23日	8月26日	8月27日	8月28日
加重平均金利	▲0.052	▲0.047	▲0.041	▲0.043
東京レポレート(ON)	▲0.080	▲0.083	▲0.085	▲0.084
無コール残	91,899	89,884	90,565	95,440
ON	57,854	55,419	55,620	59,665
その他	34,045	34,465	34,945	35,775
有コール残	20,306	20,193	19,692	20,343

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30日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想	
8:30	7月有効求人倍率	-	18:00	(欧)8月消費者物価コア指数[前年比]	1.0%
8:30	7月失業率	-	18:00	(欧)8月失業率	7.5%
8:50	7月鉱工業生産指数[前月比]	-	21:30	(米)7月個人消費支出	0.5%

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

## 本日の市況

	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	▲0.050	▲0.086
T/N	-	-	-	▲0.090
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.030	▲0.037	▲0.090
2W	-	-	▲0.015	▲0.092
3W	-	-	-	▲0.098
1M	-	-	-	▲0.105
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.001	▲0.129
6M	-	-	-	▲0.156
1Y	-	-	-	▲0.168

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

本日の無担保コールON物は、▲0.050%の出合から始まった。その後は、主に▲0.060%~▲0.040%の水準で取引された。ビッドサイドの様子見姿勢が継続し、地合は昨日より弱含む展開となり、同加重平均金利(速報)は▲0.050%(前営業日対比▲0.007%)に低下した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.050	▲0.070 ~ ▲0.050	▲0.060 ~ ▲0.040

## 翌営業日のマーケット

月末要因で調達を控える先もあると想定されるため、本日よりさらに地合は弱含むと予想。

## 資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	8月29日	8月30日	9月2日
券	▲600	+300	+1,000
財政	▲1,400	+1,200	▲20,000
過不足	▲2,000	+1,500	▲19,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)			▲2,300
CP等買入	▲300	▲800	+3,000
社債等買入		▲200	
ETF買入	+600		
国債補完供給	+200	▲300	+300
当座預金増減	▲1,800	+3,800	▲21,300
当座預金残高	4,034,600	4,038,400	4,017,100
準備預金残高	3,507,600	主な需給要因	
積み終了先	3,507,200		
超過準備	3,506,600		
非準備預金残高	527,000		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	45.2%		
乖離率	54.7%		

## 8月29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(8/29~8/30)	250	250	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [億円]  
8月28日時点 5,159,300

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,178,500
8月30日以降の残り所要積数	4,000
平均	200

## 国庫短期証券入札予定

## 今月の国債買入オペ予定

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	
9月3日	10年	
9月5日	30年	
9月11日	5年	
9月18日	20年	

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。