

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年8月30日(金)

## 短期市場の推移

[億円] [%]

	8月26日	8月27日	8月28日	8月29日
加重平均金利	▲0.047	▲0.041	▲0.043	▲0.050
東京レポレート(ON)	▲0.083	▲0.085	▲0.084	▲0.086
無コール残	89,884	90,565	95,440	98,505
ON	55,419	55,620	59,665	62,200
その他	34,465	34,945	35,775	36,305
有コール残	20,193	19,692	20,343	18,648

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。

## 9月2日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
13:00	日銀当座預金増減要因と金融調節(8月実績)	-	(米)休場(レーバーデー)	-
16:00	債券市場サーベイ(2019年8月調査)	-	(欧)製造業PMI確報(8月)	-

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	▲0.086	0.001	▲0.061	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.089
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	0.000	▲0.036	▲0.090
2W	▲0.040	▲0.025	▲0.036	▲0.092
3W	-	-	▲0.005	▲0.098
1M	-	-	-	▲0.114
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.131
6M	-	-	-	▲0.157
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

## 本日の市況

本日の無担保コールON物は、▲0.060%の出合から始まった。その後は、主に▲0.075%~▲0.045%の水準で取引された。月末で調達を控える先もあったため、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▲0.061%(前営業日対比▲0.011%)に低下した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.065	▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.070 ~ ▲0.045

## 翌営業日のマーケット

月末要因が剥落するものの、地合に大きな変化はなく、横ばい圏での推移を予想する。

## 資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月30日	9月2日	9月2日	9月3日	9月3日	9月3日
券		+200	+900	+1,000		
財政		▲300	▲32,000	▲5,000		
過不足		▲100	▲31,100	▲4,000		
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			+12,400			
共通担保(全店)			▲2,300	+2,200		
CP等買入	▲800	+3,000	▲100			
社債等買入	▲200		▲100			
国債補完供給	+300	▲300	+300			
成長基盤強化支援				▲5,500	+1,900	
当座預金増減		+1,900	▲18,700	▲7,600		
当座預金残高		4,036,500	4,017,800	4,010,200		
準備預金残高		3,511,800	主な需給要因			
積み終了先		3,511,500				
超過準備		3,511,400				
非準備預金残高		524,700				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		54.8%				
乖離率		45.1%				

8月30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(9/2~)						
~1年	500	1,257	501	0.011	0.013	43.1
1~3年	4,000	19,246	4,003	0.009	0.010	72.9
3~5年	3,600	9,370	3,605	0.005	0.006	44.9
5~10年	4,000	11,391	4,003	0.016	0.017	98.3
国債補完供給(8/30~9/2)						
共通担保(全店)(9/2~9/17)		254	254	▲0.350	▲0.350	
	15,000	2,219	2,219			

マナタリーベース [億円]  
8月29日時点 5,158,100

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,179,800  
9月2日以降の残り所要積数 3,000  
平均 200

## 国庫短期証券入札予定

9月6日	3ヶ月	第855回
9月9日	6ヶ月	
9月13日	3ヶ月	
9月18日	1年	
国債入札予定		
9月3日	10年	
9月5日	30年	
9月11日	5年	
9月18日	20年	

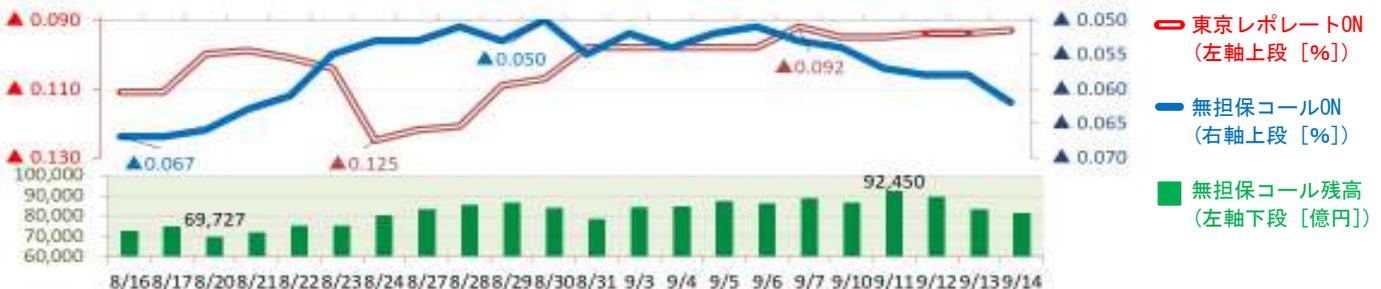
## 来月の国債買入オペ予定

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30日	2
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	6 17 24 30	8月30日	4
5年超10年以下	2,500~5,500 程度	4,000	6 12 20 26	8月30日	4
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 12 20	8月26日	3
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	8月26日	2
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(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会