

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年8月28日(火)

## 短期市場の推移

[億円] [%]

	8月22日	8月23日	8月24日	8月27日
加重平均金利	▲0.061	▲0.055	▲0.053	▲0.054
東京レポレート(ON)	▲0.101	▲0.104	▲0.125	▲0.122
無コール残	75,387	75,382	80,530	83,251
ON	48,102	47,097	51,485	48,851
その他	27,285	28,285	29,045	34,400
有コール残	19,004	16,135	13,493	16,093

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29日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	預金種別店頭表示金利の平均年利率等	-	20:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]	-
8:50	貸出約定平均金利(7月)	-	21:30	(米)4-6月期国内総生産(GDP)改定値[前期比年率]	4.0%
10:30	【挨拶】鈴木審議委員(沖縄)	-	-	-	-

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	▲0.086	0.001	▲0.051	▲0.121
T/N	-	-	0.000	▲0.154
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.038	0.001	▲0.024	▲0.158
2W	▲0.040	▲0.030	▲0.033	▲0.146
3W	-	-	0.005	▲0.143
1M	▲0.045	0.001	▲0.030	▲0.142
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.142
6M	-	-	-	▲0.150
1Y	-	-	-	▲0.159

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、▲0.055%の合出から始まった。その後は主に▲0.08~▲0.025%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.003%の▲0.051%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.073	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.080 ~ ▲0.025

## 翌営業日のマーケット

引き続き、地銀業態を中心に調達ニーズが底堅い展開を予想する。

## 資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月28日	8月29日	8月29日	8月30日	8月30日	8月31日
券	▲300	+300	▲300	+300	▲1,000	+1,000
財政	+500	▲7,200	+500	▲7,200	+1,000	+1,000
過不足	+200	▲6,900	+200	▲6,900	+0	+0
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				
CP等買入	▲500		▲100			
ETF買入				+300		
国債補完供給	+1,300	▲900	+900			
当座預金増減	+2,600	▲5,800	+2,600	▲5,800	+0	+0
当座預金残高	3,933,500	3,927,700	3,933,500	3,927,700	3,927,700	3,927,700
準備預金残高	3,434,100		3,434,100			
積み終了先	3,433,400		3,433,400			
超過準備	3,433,400		3,433,400			
非準備預金残高	499,400		499,400			
準備預金進捗率	99.8%		99.8%			
平均	41.9%		41.9%			
乖離率	57.8%		57.8%			

## 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
米ドル資金供給(8/30~9/7)		0	0	2,420	2,420	
CP等買入(8/31~)	2,000	6,115	1,985	▲0.001	0.001	64.5
国債補完供給(8/28~8/29)	52,133	832	832	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
8月27日時点 5,025,400	今積期の所要準備額 3,120,700
	8月29日以降の残り所要積数 7,300
	平均 400

## 国庫短期証券入札予定

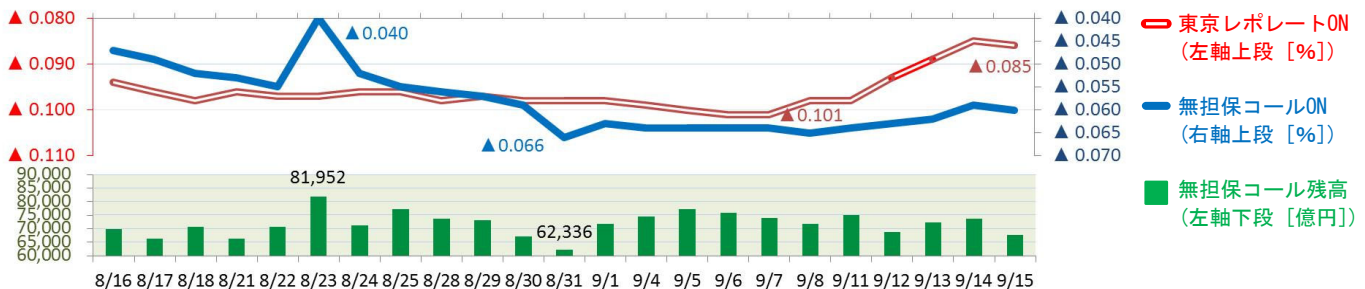
8月31日	3ヶ月	第780回
9月6日	6ヶ月	
9月7日	3ヶ月	
9月14日	3ヶ月	
国債入札予定		
8月30日	2年	
9月5日	10年	
9月11日	30年	
9月13日	5年	

## 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1日	1
1年超3年以下	2,000~3,000 程度	2,500			
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,000	1 8 10 17 24	31	8月24日 1
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,000	3 8 15 22 24	31	8月24日 1
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	500~1,500 程度	600	3 10 15 22 29		8月22日 1
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	8月22日	0
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	8月17日	0

## 1年前の市場推移

○2017年8月積み期 [8月16日~9月15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