

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年8月30日(木)

## 短期市場の推移

[億円] [%]

	8月24日	8月27日	8月28日	8月29日
加重平均金利	▲0.053	▲0.054	▲0.051	▲0.053
東京レポレート(ON)	▲0.125	▲0.122	▲0.121	▲0.109
無コール残	80,530	83,251	85,296	86,527
ON	51,485	48,851	52,166	53,107
その他	29,045	34,400	33,130	33,420
有コール残	13,493	16,093	13,623	15,947

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31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	1.63倍	18:00	(欧)7月失業率 8.2%
8:30	7月失業率	+2.4%	18:00	(欧)8月消費者物価コア指数[前年比] 1.1%
19:30頃	日銀当座預金増減要因と金融調節(8月実績速報)	-	22:45	(米)8月シカゴ購買部協会景気指数 63.0

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	▲0.051	▲0.107
T/N	-	-	0.000	▲0.142
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.033	▲0.023	▲0.024	▲0.134
2W	-	-	▲0.035	▲0.131
3W	-	-	-	▲0.134
1M	▲0.020	0.090	0.002	▲0.139
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.141
6M	-	-	-	▲0.149
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▲0.075~▲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+0.002%の▲0.051%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.070 ~ ▲0.055	▲0.075 ~ ▲0.025

## 翌営業日のマーケット

月末となる明日は、調達を控える金融機関が出る見込み。本日と比べて、やや弱い地合いになると予想。

## 資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	8月30日	8月31日	8月31日	9月3日	9月3日
券	▲800	▲100	▲100	+1,000	▲1,000
財政	▲1,500	+500	+500	▲35,000	▲35,000
過不足	▲2,300	+400	+400	▲34,000	▲34,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入		+3,200			
共通担保(全店)				▲1,100	
CP等買入	▲300		▲2,100	+2,000	
社債等買入			▲100		
ETF買入				+500	▲6,600
国債補完供給	+400	▲300	+300		
成長基盤強化支援					
当座預金増減	+700	+1,000	+1,000	▲41,700	
当座預金残高	3,925,600	3,926,600	3,926,600	3,884,900	
準備預金残高	3,419,700	主な需給要因			
積み終了先	3,419,100				
超過準備	3,419,100				
非準備預金残高	505,900	国庫短期証券発行・償還(3M)			
準備預金進捗率	99.8%	国債発行(2年)			
平均	48.4%				
乖離率	51.4%				

## 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
国債補完供給(8/30~8/31)						
	20,000	241	241	▲0.600	▲0.600	
	9,878	58	58	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]  
8月29日時点 5,019,400

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,120,200  
8月31日以降の残り所要積数 6,100  
平均 400

## 国庫短期証券入札予定

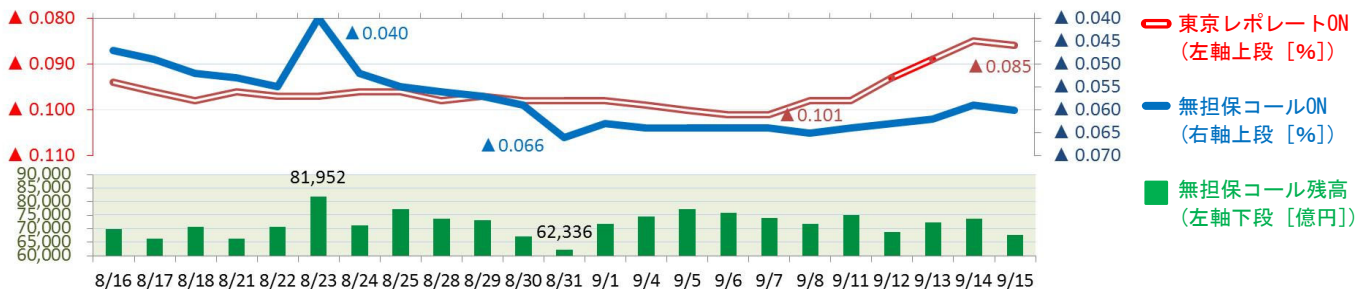
## 今月の国債買入オペ予定

8月31日	3ヶ月	第780回
9月6日	6ヶ月	第781回
9月7日	3ヶ月	
9月14日	3ヶ月	
9月5日	10年	
9月11日	30年	
9月13日	5年	
9月20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29日	0
1年超3年以下	2,000~3,000 程度	2,500	1 8 10 17 24	31 8月24日	1
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,000	3 8 15 22 24	31 8月24日	1
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,000	3 8 10 15 22 29	8月29日	0
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	500~1,500 程度	600			
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。