

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年8月31日(金)

短期市場の推移

	8月27日	8月28日	8月29日	8月30日
加重平均金利	▲0.054	▲0.051	▲0.053	▲0.050
東京レポレート(ON)	▲0.122	▲0.121	▲0.109	▲0.107
無コール残	83,251	85,296	86,527	83,988
ON	48,851	52,166	53,107	52,518
その他	34,400	33,130	33,420	31,470
有コール残	16,093	13,623	15,947	14,532

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。

9月3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)	-	10:45 (中)8月財新製造業PMI	50.7
14:40頃 【講演】黒田総裁(株指指数先物30周年記念シンポジウム)	-	17:30 (英)8月製造業購買担当者指数(PMI)	54.1
16:00 債券市場サーベイ(2018年8月調査)	-	(米)休場(レーバーデー)	-

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	▲0.055	▲0.098
T/N	-	-	0.000	▲0.101
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.038	0.001	▲0.026	▲0.108
2W	-	-	-	▲0.112
3W	-	-	-	▲0.117
1M	-	-	-	▲0.135
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.136
6M	-	-	-	▲0.149
1Y	-	-	-	▲0.157

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、▲0.045%の出合から始まった。その後は主に▲0.070%~▲0.030%の水準で取引された。月末であることから調達を見送る先もあり、調達一巡後は▲0.086%での出合も見られるやや弱い地合となった。同加重平均金利(速報)は前日対比▲0.004%の▲0.055%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.085	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.086 ~ ▲0.029

翌営業日のマーケット

週明け月曜日は、月末に調達を控えていた金融機関のビッドが戻り、本日より、堅調な地合いになると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月31日	9月3日	8月31日	9月3日	8月31日	9月3日
券		+0		+800		+1,000
財政		+800		▲41,200		▲34,000
過不足		+800		▲40,400		▲33,000
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				+9,700		
共通担保(全店)			▲1,100	+1,300		
CP等買入	▲2,100	+2,000	▲100			
社債等買入	▲100					
ETF買入		+500				
国債補完供給	+300	▲1,800	+1,800			
成長基盤強化支援			▲4,600	+2,900		
当座預金増減		▲400		▲30,500		▲33,000
当座預金残高		3,925,200		3,894,700		3,861,700
準備預金残高		3,444,400				
積み終了先		3,443,900				
超過準備		3,443,900				
非準備先残高		480,800				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		58.1%				
乖離率		41.8%				

8月31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(9/3~)						
1~3年	2,500	8,249	2,507	▲0.002	0.000	1.9
3~5年	3,000	10,249	3,004	▲0.004	▲0.004	53.6
5~10年	4,000	13,573	4,012	▲0.004	▲0.004	76.9
国債補完供給(8/31~9/3)						
57,135	1,601	1,601	▲0.600	▲0.605		
9,945	125	125	▲0.600	▲0.600		
共通担保(全店)(9/3~9/18)						
8,000	1,291	1,291				

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
8月30日時点 5,020,900	今積期の所要準備額 3,121,300
	9月3日以降の残り所要積数 4,500
	平均 300

国庫短期証券入札予定

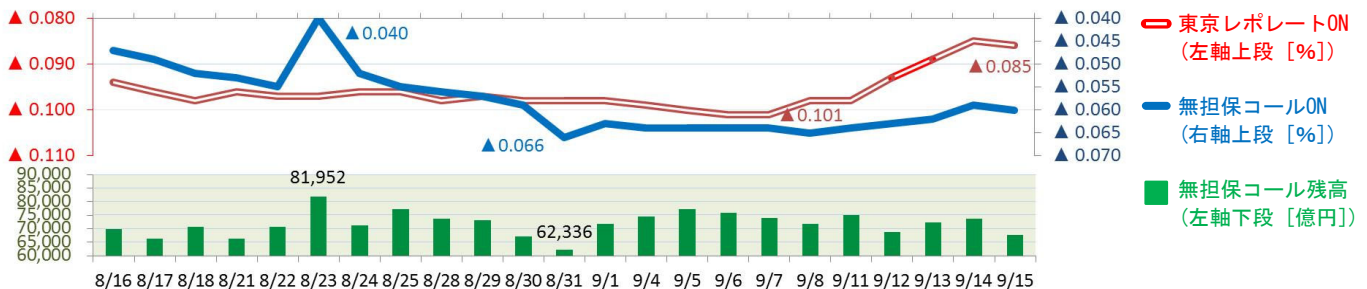
9月6日	6ヶ月	第781回
9月7日	3ヶ月	第782回
9月14日	3ヶ月	
9月18日	1年	
9月5日	10年	
9月11日	30年	
9月13日	5年	
9月20日	20年	

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29日	2
1年超3年以下	2,000~4,000 程度	2,500			
3年超5年以下	2,500~4,500 程度	3,000	4 10 14 21 24	8月31日	5
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,000	6 10 12 18 25	8月31日	5
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	500~1,500 程度	600	4 12 18 21 27	8月29日	5
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	8月22日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000		8月17日	-

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。