

短期市場の推移

	9月25日	9月26日	9月27日	9月30日
加重平均金利	▲0.058	▲0.055	▲0.046	▲0.064
東京レポレート(ON)	▲0.083	▲0.091	▲0.093	▲0.116
無コール残	91,954	95,092	88,919	60,524
ON	60,939	63,657	59,374	45,044
その他	31,015	31,435	29,545	15,480
有コール残	21,232	21,135	20,995	14,574

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。

10月2日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マナターベース(9月)	-	20:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]
8:50	短観(9月調査全容)	-	21:15	(米)9月ADP全米雇用報告
				13.8万人

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	▲0.080	0.001	▲0.048	▲0.097
T/N	-	-	-	▲0.089
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.000	▲0.029	▲0.093
2W	▲0.025	0.000	▲0.016	▲0.096
3W	-	-	-	▲0.102
1M	▲0.020	0.480	▲0.008	▲0.108
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.164
6M	-	-	-	▲0.176
1Y	-	-	-	▲0.193

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%の出合から始まり、その後は主に▲0.065%~▲0.020%のレンジで取引された。四半期末要因が剥落し、資金調達ニーズが強まった結果、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.016%の▲0.048%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.060	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.060 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

税揚げ要因により、出合の水準は本日よりも若干上昇すると予想する。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	10月1日	10月2日	10月3日
券	+700	+500	▲1,000
財政	▲26,400	▲68,300	+1,000
過不足	▲25,700	▲67,800	+0
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+1,000
国債買入		+7,800	
CP等買入		▲100	
国債補完供給	+1,100		
当座預金増減	▲16,800	▲66,900	+0
当座預金残高	4,067,300	4,000,400	4,000,400
準備預金残高	3,540,200	主な需給要因	
積み終了先	3,539,800		
超過準備	3,539,800		
非準備先残高	527,100	国債発行(10年)	
準備預金進捗率	99.9%	税・保険揚げ	
平均	53.3%		
乖離率	46.5%		

10月1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
国庫短期証券買入(10/2~)	1,000	4,426	1,000	0.006	0.012	25.8
米ドル資金供給(10/3~10/10)		1	1	2.350	2.350	
国債補完供給(10/1~10/2)		0	0	▲0.350	▲0.350	

マナターベース [億円]
9月30日時点 5,204,800

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,085,600
10月2日以降の残り所要積数 3,600
平均 300

国庫短期証券入札予定

10月4日	3ヶ月	第861回
10月9日	6ヶ月	
10月11日	3ヶ月	
10月17日	1年	
10月10日	30年	
10月17日	5年	
10月24日	20年	
10月29日	2年	

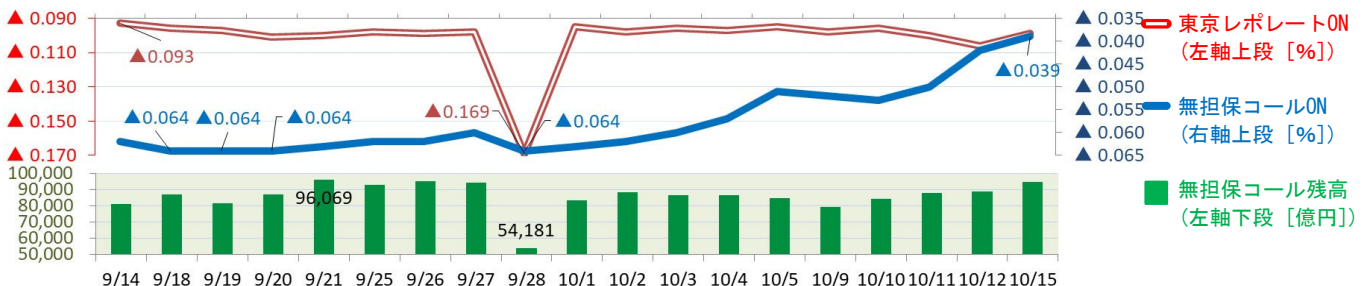
今月の国債買入オペ予定

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	9月24日	2
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200		9月30日	4
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	7 15 21 28	9月26日	4
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	4 15 21 28	9月20日	3
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200	7 18 30	9月26日	2
25年超	0~500 程度	300		8月5日	1
物価連動債	250 程度	250	月2回程度		
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	月1回		

1年前の市場推移

○2018年9月積み期 [9月14日~10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(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会