

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年10月3日(木)

短期市場の推移

	9月27日	9月30日	10月1日	10月2日
加重平均金利	▲0.046	▲0.064	▲0.048	▲0.036
東京レポレート(ON)	▲0.093	▲0.116	▲0.097	▲0.073
無コール残	88,919	60,524	77,448	78,799
ON	59,374	45,044	56,643	58,194
その他	29,545	15,480	20,805	20,605
有コール残	20,995	14,574	21,082	21,376

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4日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
【記者会見】 布野審議委員(10月3日)	-	(米)FRB議長あいさつ	-
-	-	21:30 (米)9月失業率	3.6%
-	-	21:30 (米)8月貿易収支	-550.0億米ドル

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	▲0.070	0.001	▲0.019	▲0.052
T/N	-	-	▲0.005	▲0.049
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.015	▲0.010	▲0.013	▲0.057
2W	-	-	-	▲0.066
3W	▲0.010	0.000	▲0.008	▲0.076
1M	-	-	-	▲0.091
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.165
6M	-	-	-	▲0.185
1Y	-	-	-	▲0.201

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、▲0.020%の出合から始まり、その後は主に▲0.025%～▲0.015%のレンジで取引された。昨日よりも一層調達意欲が強くなり、同加重平均金利(速報)は▲0.019%と、2019年8月14日以来約1か月半ぶりの高さとなった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.020	▲0.025 ~ ▲0.015	▲0.020 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

週末3日積みとなるため、地合いは本日と同様かやや強含むと予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	10月3日		10月4日		10月7日
券	▲100		+600		+1,000
財政	+100		▲3,400		▲2,000
過不足	+0		▲2,800		▲1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)	▲200		▲200		▲3,100
CP等買入	+200		+200		
国債補完供給	▲200		+200		
当座預金増減	▲200		▲2,600		▲4,100
当座預金残高	3,999,900		3,997,300		3,993,200
準備預金残高	3,485,500		3,484,900		
積み終了先	3,484,900		3,484,900		
超過準備	3,484,900		3,484,900		
非準備先残高	514,400		514,400		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		
平均	60.0%		60.0%		
乖離率	39.9%		39.9%		

10月3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(10/3~10/4)	188	188	▲0.350	▲0.350		

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	第862回
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		

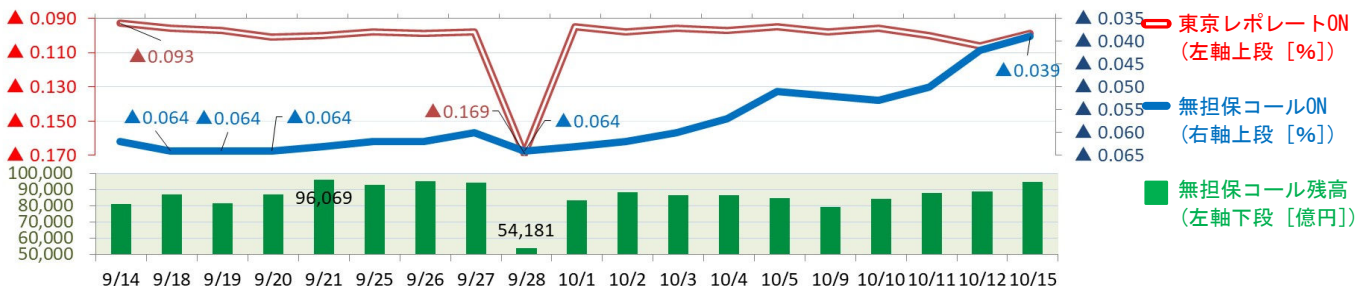
マナタリーベース [億円]
10月2日時点 5,119,500

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,085,600
10月4日以降の残り所要積数 2,500
平均 200

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。