

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年9月5日(水)

短期市場の推移

	8月30日	8月31日	9月3日	9月4日
加重平均金利	▲0.050	▲0.055	▲0.052	▲0.054
東京レポレート(ON)	▲0.107	▲0.098	▲0.098	▲0.098
無コール残	83,988	78,360	84,386	84,736
ON	52,518	47,420	53,206	53,216
その他	31,470	30,940	31,180	31,520
有コール残	14,532	25,221	27,387	26,044

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。

9月6日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
10:30	【挨拶】片岡審議委員(神奈川)	21:15	(米)8月ADP全米雇用報告 191.1万人
-	-	23:00	(米)8月ISM非製造業景況指数 56.8
-	-	-	(米)ニューヨーク連銀総裁の講演

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	▲0.052	▲0.098
T/N	-	-	0.000	▲0.101
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.033	▲0.025	▲0.028	▲0.106
2W	▲0.033	▲0.025	▲0.030	▲0.110
3W	-	-	▲0.040	▲0.117
1M	-	-	-	▲0.137
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.139
6M	-	-	-	▲0.149
1Y	-	-	-	▲0.158

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、▲0.055%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▲0.0052%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.073	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.070 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

本日と同様に地銀業態を中心にビッドが厚く、堅調な地合が継続すると予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月5日	9月6日	9月5日	9月6日	9月7日	9月8日
券	+900	▲100				+0
財政	▲8,800	▲23,300				+3,000
過不足	▲7,900	▲23,400				+3,000
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		+9,000				
CP等買入	▲400		▲200			+4,500
社債等買入	▲200					
国債補充供給	+900	▲1,400	+1,400			
当座預金増減	+0	▲22,200				+7,500
当座預金残高	3,870,000	3,847,800				3,855,300
準備預金残高	3,385,000					
積み終了先	3,384,400					
超過準備	3,384,400					
非準備先残高	485,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	67.7%					
乖離率	32.2%					

9月5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(9/7~9/13)		1	1	2,420	2,420	
国債補充供給(9/5~9/6)	41,000	1,333	1,333	▲0.600	▲0.600	
	20,808	75	75	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]
9月4日時点 4,964,400

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,121,300
9月6日以降の残り所要積数 2,700
平均 300

国庫短期証券入札予定

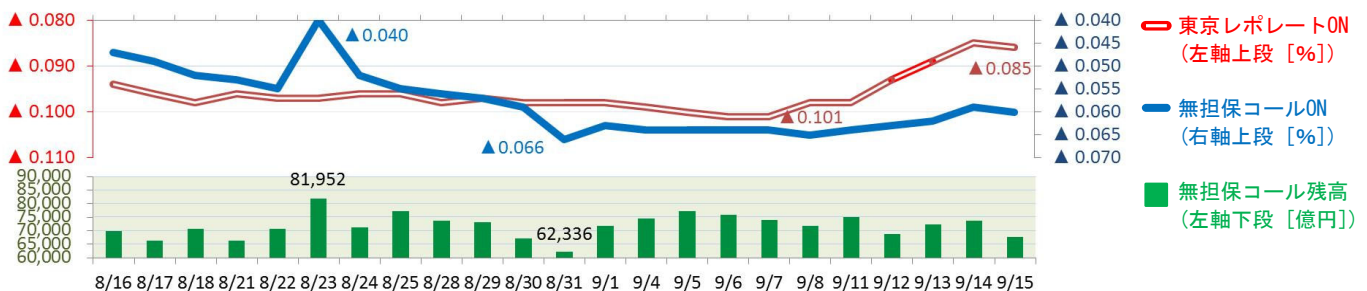
9月6日	6ヶ月	第781回
9月7日	3ヶ月	第782回
9月14日	3ヶ月	
9月18日	1年	
9月11日	30年	
9月13日	5年	
9月20日	20年	
9月26日	40年	

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29日	2
1年超3年以下	2,000~4,000 程度	3,000			
3年超5年以下	2,500~4,500 程度	3,500	4	10 14 21 24	9月4日 4
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	9月4日 4
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。

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