

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年9月6日(木)

短期市場の推移

[億円] [%]

	8月31日	9月3日	9月4日	9月5日
加重平均金利	▲0.055	▲0.052	▲0.054	▲0.052
東京レポレート(ON)	▲0.098	▲0.098	▲0.098	▲0.098
無コール残	78,360	84,386	84,736	87,402
ON	47,420	53,206	53,216	54,922
その他	30,940	31,180	31,520	32,480
有コール残	25,221	27,387	26,044	25,125

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。

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	▲0.073	0.001	▲0.051	▲0.098
T/N	-	-	0.000	▲0.101
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.033	▲0.020	▲0.026	▲0.106
2W	-	-	▲0.033	▲0.111
3W	-	-	▲0.010	▲0.120
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

9月7日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
14:00	7月景気動向指数(内閣府)	-	18:00	(欧)4-6月期域内総生産(GDP)確報値[前年比]	2.2%
15:00	コール市場残高(8月)	-	21:30	(米)8月非農業部門雇用者数	19.1万人
-	【記者会見】 片岡審議委員(9月6日)	-	21:30	(米)8月失業率	3.9%

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

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▲0.070~▲0.035%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+0.001%の▲0.051%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.065		▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.070 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

週末3日積みとなる明日も、地銀業態を中心に調達ニーズが強く、出合の中心レートは小幅上昇方向と予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報 9月6日	日銀予想 9月7日	当社需給予想 9月10日
券	▲200	+600	+1,000
財政	▲24,300	+900	▲21,000
過不足	▲24,500	+1,500	▲20,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+5,500	
共通担保(全店)			▲2,200
CP等買入	▲200	▲600	
社債等買入		▲100	
国債補完供給	+1,400	▲400	+400
当座預金増減	▲23,700	+11,200	▲22,200
当座預金残高	3,846,300	3,857,500	3,835,300
準備預金残高	3,363,000	主な需給要因	
積み終了先	3,362,400		
超過準備	3,362,400		
非準備預金残高	483,300		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	71.0%		
乖離率	28.9%		

9月6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	按分
国債買入(9/7~)						
~1年	500	1,229	500	0.047	0.057	85.4
5~10年	4,500	14,138	4,514	▲0.005	▲0.005	75.5
物価連動	250	1,274	254	▲0.120	▲0.131	88.8
国債補完供給(9/6~9/7)						
	112,907	406	406	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]
9月5日時点 4,963,500

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,121,300
9月7日以降の残り所要	
積数	2,000
平均	200

国庫短期証券入札予定

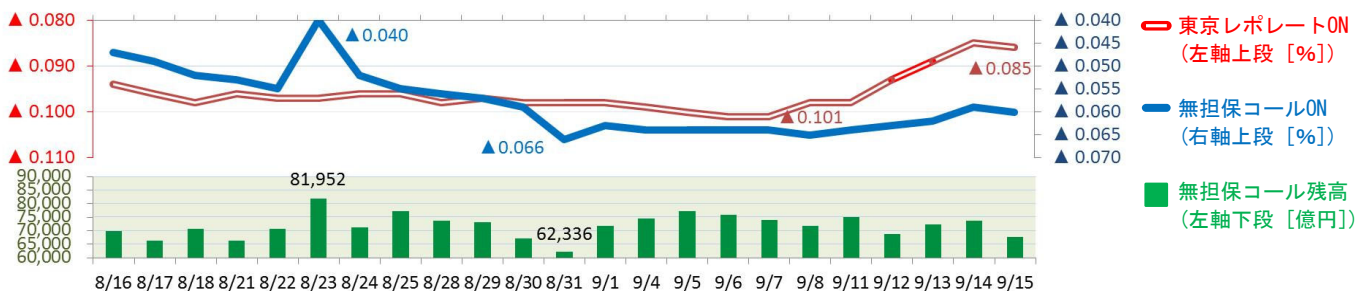
9月7日	3ヶ月	第782回
9月14日	3ヶ月	
9月18日	1年	
9月21日	3ヶ月	
国債入札予定		
9月11日	30年	
9月13日	5年	
9月20日	20年	
9月26日	40年	

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	9月6日	1
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	4,500	6 10 12 18 25	9月6日	4
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800	4 12 18 21 27	9月4日	4
25年超	500~1,500 程度	600			
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	9月6日	1
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