

# DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年9月10日(月)

短期市場の推移

[億円][%]

	9月4日	9月5日	9月6日	9月7日
加重平均金利	▲0.054	▲0.052	▲0.051	▲0.053
東京レポレート(ON)	▲0.098	▲0.098	▲0.098	▲0.092
無コール残	84,736	87,402	86,082	88,797
ON	53,216	54,922	54,512	58,327
その他	31,520	32,480	31,570	30,470
有コール残	26,044	25,125	25,106	26,746

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11日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネーストック(8月)	-	17:30	(英)8月失業率
13:30	7月の第3次産業活動	-	23:00	(米)7月JOLT求人件数

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	▲0.054	▲0.095
T/N	-	-	0.000	▲0.098
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.010	▲0.103
2W	-	-	-	▲0.109
3W	-	-	-	▲0.138
1M	-	-	-	▲0.133
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.135
6M	-	-	-	▲0.148
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。先週末の地合いと大きな変化はなく、その後は主に▲0.070～▲0.030%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▲0.054%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.070	▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.070 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

明日も地銀業態を中心にビッドが厚く、引続き底堅い地合いになると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報 9月10日	日銀予想 9月11日	当社需給予想 9月12日
券	+600	+100	+0
財政	▲20,700	▲1,000	▲10,000
過不足	▲20,100	▲900	▲10,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+7,500
国債買入			+11,200
共通担保(全店)	▲2,200	+1,400	
CP等買入	▲600		▲200
国債補完供給	+200		
当座預金増減	▲21,300	+17,600	▲10,000
当座預金残高	3,836,100	3,853,700	3,843,700
準備預金残高	3,382,500	主な需給要因	
積み終了先	3,382,400	源泉税揚げ	
超過準備	3,382,400	国債発行	
非準預先残高	453,600	(30年)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	83.9%		
乖離率	16.0%		

9月10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(9/11~)	7,500	29,774	7,503	0.000	0.002	56.7
国債買入(9/11~)						
1~3年	3,000	9,819	3,012	0.001	0.002	4.8
3~5年	3,500	13,257	3,507	0.003	0.003	42.5
5~10年	4,500	14,273	4,509	0.003	0.004	20.6
国債補完供給(9/10~9/11)						
	25,228	0	0			
	30,000	5	5	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
9月7日時点 4,950,500	今積期の所要準備額 3,098,100
	9月11日以降の残り所要積数 700
	平均 100

国庫短期証券入札予定

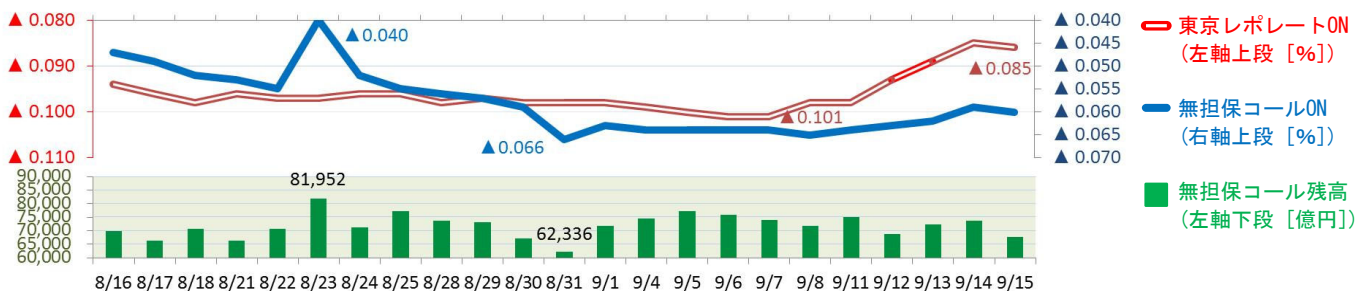
9月14日	3ヶ月	第783回
9月18日	1年	
9月21日	3ヶ月	
9月28日	3ヶ月	
国債入札予定		
9月11日	30年	
9月13日	5年	
9月20日	20年	
9月26日	40年	

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10日	3
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	6 10 12 18 25	9月10日	3
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	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。