

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年9月11日(火)

短期市場の推移

[億円][%]

	9月5日	9月6日	9月7日	9月10日
加重平均金利	▲0.052	▲0.051	▲0.053	▲0.054
東京レポレート(ON)	▲0.098	▲0.098	▲0.092	▲0.095
無コール残	87,402	86,082	88,797	86,434
ON	54,922	54,512	58,327	55,984
その他	32,480	31,570	30,470	30,450
有コール残	25,125	25,106	26,746	25,193

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12日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
10:00 日銀営業毎旬報告(9月10日現在)	-	(米)ペー・ジュブック	-
17:00頃 日本銀行が保有する国債の銘柄別残高	-	20:00 (米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]	-
17:00頃 日本銀行による国庫短期証券の銘柄別買入額	-	21:30 (米)8月生産者物価コア指数[前年比]	2.7%

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	▲0.057	▲0.095
T/N	-	-	0.000	▲0.098
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	▲0.025	▲0.030	▲0.103
2W	-	-	▲0.035	▲0.110
3W	-	-	-	▲0.138
1M	-	-	-	▲0.133
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.135
6M	-	-	-	▲0.146
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、▲0.060%の出合から始まった。その後は主に▲0.080~▲0.030%のレンジで取引された。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比▲0.003%の▲0.057%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

積最終日を前にビッドは厚いものの、大きく取り上がる動きまでは至らず、本日は横ばい圏で推移すると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月11日	9月12日	9月12日	9月13日	9月13日	9月13日
券		+100	+600	+0		
財政		▲2,300	▲9,400	+4,000		
過不足		▲2,200	▲8,800	+4,000		
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
国庫短期証券買入		+7,500				
国債買入		+11,200				
CP等買入	▲200		▲400			
ETF買入			+200			
当座預金増減		+16,300	▲9,000	+4,000		
当座預金残高		3,852,400	3,843,400	3,847,400		
準備預金残高		3,388,100	主な需給要因			
積み終了先		3,388,000				
超過準備		3,388,000				
非準備預金残高		464,300				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		87.1%				
乖離率		12.8%				

9月11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(9/13~9/20)		1	1	2,410	2,410	
CP等買入(9/14~)	5,000	11,160	5,000	▲0.016	▲0.010	34.3
国債補充完供給(9/11~9/12)	11,175	1	1	▲0.600	▲0.600	
	23,248	6	6	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]
9月10日時点 4,928,700

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,098,100
9月12日以降の残り所要
積数 600
平均 100

国庫短期証券入札予定

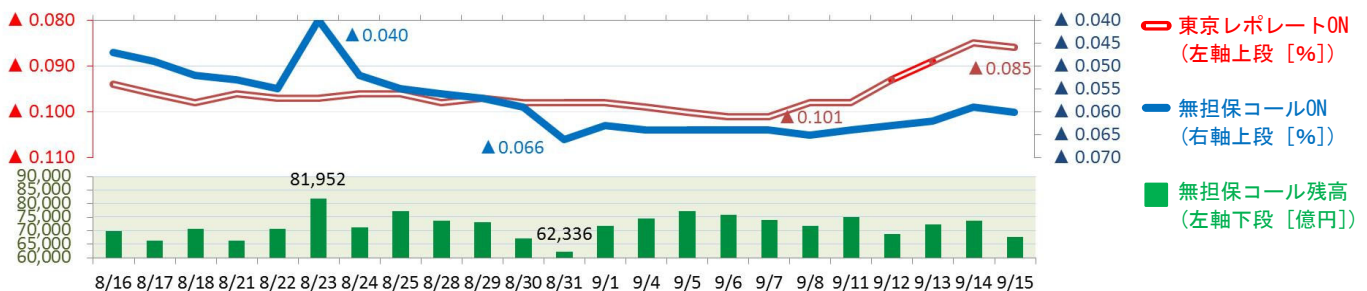
9月14日	3ヶ月	第783回
9月18日	1年	第784回
9月21日	3ヶ月	
9月28日	3ヶ月	
9月13日	5年	
9月20日	20年	
9月26日	40年	
9月28日	2年	

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。投資については最終決定は、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