

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年9月20日(木)

短期市場の推移

[億円][%]

	9月13日	9月14日	9月18日	9月19日
加重平均金利	▲0.058	▲0.062	▲0.064	▲0.064
東京レポレート(ON)	▲0.094	▲0.093	▲0.096	▲0.097
無コール残	83,354	81,468	87,033	81,913
ON	53,964	52,548	55,843	50,773
その他	29,390	28,920	31,190	31,140
有コール残	25,984	26,264	26,473	20,104

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21日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	8月消費者物価コア指数[前年比]	+0.9%	17:00	(欧)9月購買担当者総合指数(PMI)	54.4
	国債市場特別参加者会合		22:45	(米)9月製造業PMI	55.0
	-		22:45	(米)9月サービス業PMI	54.8

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	▲0.150	0.001	▲0.064	▲0.101
T/N	-	-	0.000	▲0.114
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	▲0.020	▲0.030	▲0.113
2W	-	-	0.001	▲0.130
3W	-	-	-	▲0.128
1M	-	-	-	▲0.128
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.133
6M	-	-	-	▲0.146
1Y	-	-	-	▲0.155

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、▲0.070%の出合から始まった。その後は▲0.085~▲0.035%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は、前営業日対比横ばいの▲0.064%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.080		▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.080 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

週末4日積となるものの、本日と同様に、ビッドサイドが慎重な調達姿勢となることが想定されるため、軟調な地合が予想される。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	9月20日		9月21日		9月25日
券	▲900		▲700		+1,000
財政	+71,800		▲1,200		▲3,000
過不足	+70,900		▲1,900		▲2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入				+5,000	
共通担保(全店)					▲1,400
CP等買入	▲300		▲900		
社債等買入	▲500			+1,000	
ETF買入		+700		+300	
被災地金融機関支援			▲800	+800	
国債補充供給	+900	▲1,000	+1,000		
当座預金増減	+70,700		+4,500		▲3,400
当座預金残高	3,942,800		3,947,300		3,943,900
準備預金残高	3,446,800		3,438,000		
積み終了先	3,438,000				
超過準備	3,433,900				
非準備預金残高	496,000				
準備預金進捗率	99.1%		国債発行(20年)		国庫短期証券発行・償還(3M)
平均	16.7%				
乖離率	82.4%				

9月20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(9/21~)	5,000	22,483	5,006	0.002	0.004	3.9
国債補充供給(9/20~9/21)	153,835	942	942	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
9月19日時点 4,964,100	今積期の所要準備額 2,987,900
	9月21日以降の残り所要積数 27,600
	平均 1,100

国庫短期証券入札予定

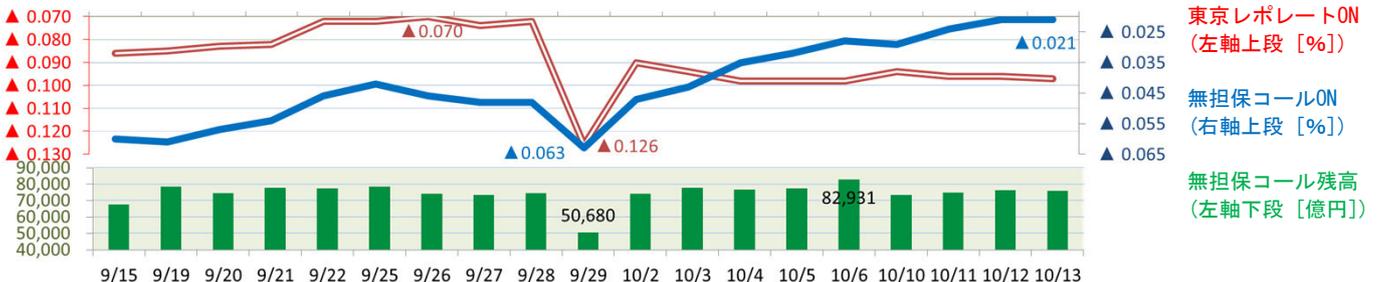
今月の国債買入オペ予定

9月21日	3ヶ月	第785回
9月28日	3ヶ月	
10月5日	3ヶ月	
10月9日	6ヶ月	
9月26日	40年	
9月28日	2年	
10月2日	10年	
10月11日	30年	

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14日	0
1年超3年以下	2,000~4,000 程度	3,000		9月14日	2
3年超5年以下	2,500~4,500 程度	3,500	4 10 14 21 24	9月18日	1
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	6 10 12 18 25	9月18日	2
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800	4 12 18 21 27	9月6日	1
25年超	500~1,500 程度	600		8月17日	-
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			

1年前の市場推移

○2017年9月積み期 [9月15日~10月13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。