

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年9月25日(火)

短期市場の推移

[億円] [%]

	9月18日	9月19日	9月20日	9月21日
加重平均金利	▲0.064	▲0.064	▲0.064	▲0.063
東京レポレート(ON)	▲0.096	▲0.097	▲0.101	▲0.100
無コール残	87,033	81,913	86,960	96,069
ON	55,843	50,773	51,540	59,339
その他	31,190	31,140	35,420	36,730
有コール残	26,473	20,104	25,301	23,339

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	▲0.085	0.001	▲0.061	▲0.098
T/N	-	-	0.000	▲0.111
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.130
2W	▲0.025	▲0.020	▲0.022	▲0.127
3W	-	-	-	▲0.126
1M	-	-	-	▲0.128
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.133
6M	-	-	-	▲0.145
1Y	-	-	-	▲0.154

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26日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
【記者会見】 黒田総裁(9月25日)	-	20:00 (米)MBA住宅ローン 申請指数[前週比]	-
-	-	FOMC、結果公表	-
-	-	パウエルFRB 議長の会見	-

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、▲0.07%の出合から始まった。
その後は▲0.08～▲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+0.002%の▲0.061%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.075	▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.070 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

引き続き、大きく取り上がる動きまでは至らず、本日同様の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25日	9月26日	9月27日
券	+200	+0	▲1,000
財政	+1,800	▲1,600	▲15,000
過不足	+2,000	▲1,600	▲16,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+2,500	▲2,500
国債買入		+4,900	▲4,900
共通担保(全店)	▲1,400		
CP等買入	▲700	▲600	
ETF買入		+200	+600
国債補完供給	+1,600	▲500	+500
当座預金増減	+12,000	+6,300	▲16,000
当座預金残高	3,958,000	3,964,300	3,948,300
準備預金残高	3,470,300		
積み終了先	3,467,900		
超過準備	3,467,900		
非準備先残高	487,700		
準備預金進捗率	99.6%		
平均	33.3%		
乖離率	66.3%		

9月25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
国庫短期証券買入(9/26～)	2,500	8,342	2,505	0.000	0.002	19.7
国債買入(9/26～)	4,500	8,832	4,511	0.003	0.004	48.0
5～10年	250	1,485	252	▲0.220	▲0.225	74.9
物価連動						
米ドル資金供給(9/27～10/4)				0	2.630	2.630
CP等買入(9/28～)	5,000	11,886	4,975	▲0.015	▲0.009	72.1
国債補完供給(9/25～9/26)	113,579	464	464	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]
9月21日時点 5,039,600

所要 [億円]
今積期の所要準備額 2,987,900
9月26日以降の残り所要
積数 11,500
平均 600

国庫短期証券入札予定

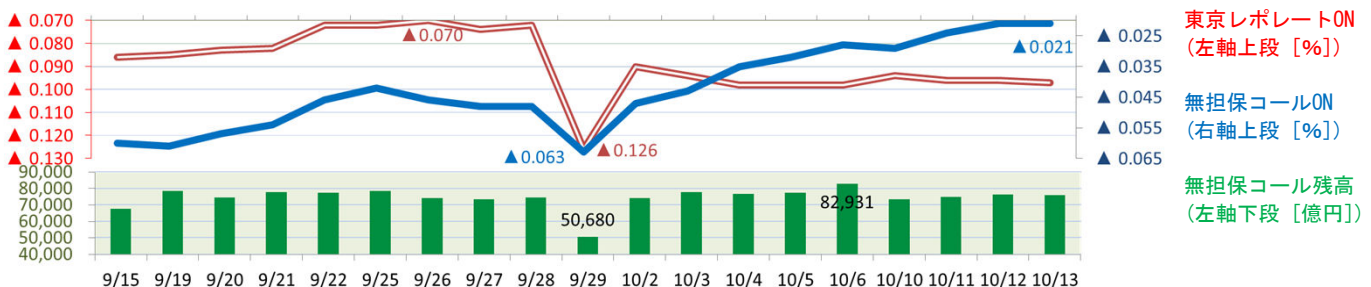
9月28日 3ヶ月 第786回
10月5日 3ヶ月
10月9日 6ヶ月
10月12日 3ヶ月
国債入札予定
9月26日 40年
9月28日 2年
10月2日 10年
10月11日 30年

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14日	0
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21日	0
5年超10年以下	3,000～6,000 程度	4,500	6 10 12 18 25	9月25日	0
10年超25年以下	1,500～2,500 程度	1,800	4 12 18 21 27	9月21日	1
25年超	500～1,500 程度	500			
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	9月25日	0
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