

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年9月26日(水)

短期市場の推移

[億円] [%]

	9月19日	9月20日	9月21日	9月25日
加重平均金利	▲0.064	▲0.064	▲0.063	▲0.062
東京レポレート(ON)	▲0.097	▲0.101	▲0.100	▲0.098
無コール残	81,913	86,960	96,069	93,236
ON	50,773	51,540	59,339	55,476
その他	31,140	35,420	36,730	37,760
有コール残	20,104	25,301	23,339	21,686

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27日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
15:35	【挨拶】黒田総裁(全国証券大会)	3:00	(米)9月連邦公開市場委員会(FOMC)政策金利 2.25%
-	-	21:00	(独)9月消費者物価指数[前年比] 2.0%
-	-	21:30	(米)4-6月期国内総生産(GDP)確報値[前期比年率] 4.3%

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	▲0.086	0.001	▲0.062	▲0.099
T/N	-	-	0.000	▲0.109
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.130
2W	-	-	▲0.015	▲0.125
3W	-	-	-	▲0.125
1M	-	-	0.002	▲0.127
2M	-	-	▲0.015	-
3M	-	-	-	▲0.132
6M	-	-	-	▲0.144
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

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。その後は主に▲0.080~▲0.035%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は、前営業日と横ばいの▲0.062%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

ビッドは引き続き厚いものの、大きく取り上がる動きは見られず、本日と横ばい圏で推移すると予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報 9月26日	日銀予想 9月27日	当社需給予想 9月28日
券	+0	▲1,100	▲1,000
財政	▲3,100	▲10,500	▲5,000
過不足	▲3,100	▲11,600	▲6,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+2,500	-	-
国債買入	+4,800	-	+5,000
CP等買入	▲600	▲1,200	-
ETF買入	+600	+100	-
国債補完供給	+500	+2,500	-
当座預金増減	+2,200	▲10,200	▲1,000
当座預金残高	3,960,200	3,950,000	3,949,000
準備預金残高	3,472,900	主な需給要因	
積み終了先	3,471,900	地方貸回収	
超過準備	3,471,200	国債発行(40年)	
非準備預金残高	487,300		
準備預金進捗率	99.7%		
平均	36.7%		
乖離率	63.0%		

9月26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
国債補完供給(9/26~9/27)	185,867	2,388	2,388	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
9月25日時点 5,051,400	今積期の所要準備額 2,987,900
	9月27日以降の残り所要積数 9,800
	平均 500

国庫短期証券入札予定

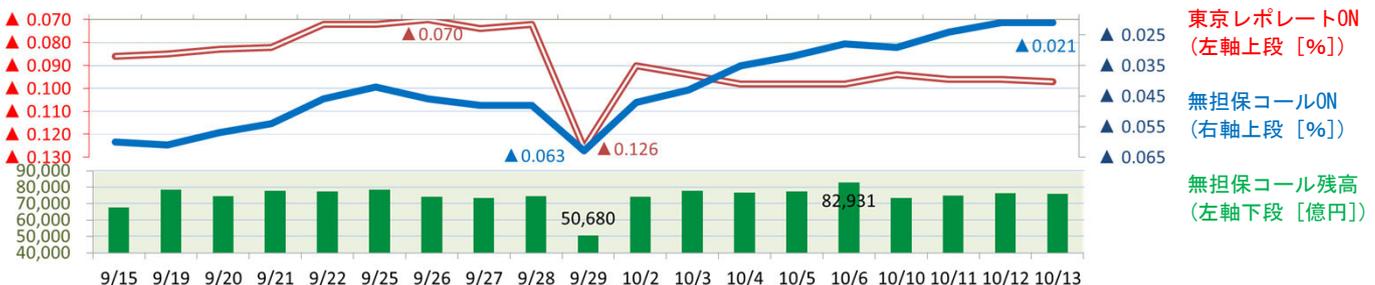
9月28日	3ヶ月	第786回
10月5日	3ヶ月	
10月9日	6ヶ月	
10月12日	3ヶ月	
9月28日	2年	
10月2日	10年	
10月11日	30年	
10月16日	5年	

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	4	10/14	27
3年超5年以下	2,500~4,500 程度	3,500	6	10/12	18
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	4	12/18	27
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
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ありません。今後予告なく変更されることがあります。