

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年10月1日(月)

短期市場の推移

[億円] [%]

	9月25日	9月26日	9月27日	9月28日
加重平均金利	▲0.062	▲0.062	▲0.060	▲0.064
東京レポレート(ON)	▲0.098	▲0.099	▲0.098	▲0.169
無コール残	93,236	95,124	94,437	54,181
ON	55,476	57,254	56,762	31,241
その他	37,760	37,870	37,675	22,940
有コール残	21,686	23,088	28,592	10,272

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。

10月2日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネタリーベース(9月)	-	18:00 (欧)8月生産者物価指数[前年比]	3.8%
8:50	短観(9月業種別計数、「企業の物価見通し」の概要)	-	(米)クオールズFRB副議長議会証言	
8:50	短観(9月調査全容)	-	(米)パウエルFRB議長の講演	

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	▲0.063	▲0.095
T/N	-	-	0.000	▲0.103
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	▲0.010	▲0.030	▲0.108
2W	▲0.035	0.001	▲0.026	▲0.111
3W	▲0.030	▲0.010	▲0.021	▲0.116
1M	▲0.030	0.000	▲0.011	▲0.124
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.141
6M	-	-	-	▲0.145
1Y	-	-	-	▲0.156

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、▲0.075%の出合から始まりその後は、主に▲0.08%~▲0.04%の水準で取引が見られた。同加重平均は前営業日対比+0.001%の▲0.063%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.083	▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.086 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

本日と同様にビッドサイドは厚いが、大きく取りあがる展開にはならないと予想する。▲0.086%~▲0.035%のレンジで取引されると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	10月1日	10月2日	10月3日
券	+1,000	+100	+0
財政	▲24,400	▲13,400	▲54,000
過不足	▲23,400	▲13,300	▲54,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)	▲1,900	+1,900	
CP等買入	▲100	▲100	
国債補完供給	+2,900	▲3,700	+3,700
当座預金増減	▲24,300	▲9,700	▲54,000
当座預金残高	3,931,500	3,921,800	3,867,800
準備預金残高	3,442,900	主な需給要因	
積み終了先	3,442,100	法人税・消費税・保険揚げ	
超過準備	3,442,100	法人税・消費税・保険揚げ	
非準備先残高	488,600	国債発行(10年)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	53.3%		
乖離率	46.6%		

10月1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(10/1~10/2)	114,109	3,497	3,497	▲0.600	▲0.600	
	44,003	66	66	▲0.600	▲0.600	

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
9月28日時点 5,050,900	今積期の所要準備額 2,992,200
	10月2日以降の残り所要積数 2,500
	平均 200

国庫短期証券入札予定

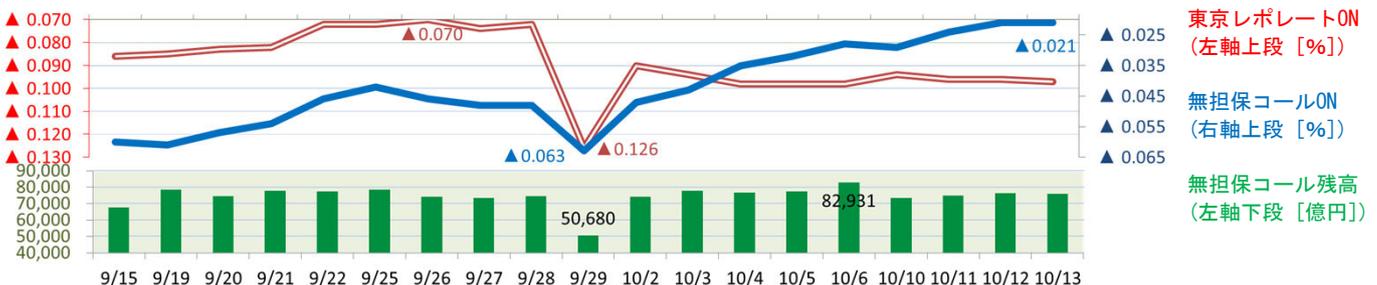
10月5日	3ヶ月	第78/回
10月9日	6ヶ月	
10月12日	3ヶ月	
10月18日	1年	
10月2日	10年	
10月11日	30年	
10月16日	5年	
10月18日	20年	

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	2
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	3 12 17 26 30	9月27日	5
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	3 10 17 24 26	9月25日	5
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800	5 12 19 24 30	9月27日	5
25年超	500~1,500 程度	500			
物価運動債	250 程度	250	月2回程度	9月25日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	8月17日	1

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。