

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年10月3日(水)

## 短期市場の推移

	9月27日	9月28日	10月1日	10月2日
加重平均金利	▲0.060	▲0.064	▲0.063	▲0.062
東京レポレート(ON)	▲0.098	▲0.169	▲0.095	▲0.098
無コール残	94,437	54,181	83,422	88,736
ON	56,762	31,241	52,602	56,771
その他	37,675	22,940	30,820	31,965
有コール残	28,592	10,272	27,967	26,098

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4日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		21:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分]

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	▲0.060	▲0.096
T/N	-	-	0.000	▲0.103
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.028	▲0.029	▲0.106
2W	-	-	▲0.028	▲0.109
3W	-	-	▲0.025	▲0.116
1M	-	-	-	▲0.123
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.143
6M	-	-	-	▲0.146
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%の合出から始まり、その後は主に▲0.085%~▲0.030%のレンジで取引された。地銀業態を中心にビッドが厚くなったため、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.060%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.080	▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.078 ~ ▲0.020

## 翌営業日のマーケット

大きく取りあがる展開にはならないが、本日と同様に地銀業態中心にビッドが厚くなると予想されるため、レートは小幅上昇か。

## 資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	10月3日	10月4日	10月5日
券	+300	▲800	▲1,000
財政	▲60,000	+800	▲5,000
過不足	▲59,700	+0	▲6,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+1,000	
国債買入			+11,000
CP等買入	▲100		
国債補完供給	+1,700	▲2,500	+2,500
当座預金増減	▲59,600	+13,500	▲6,000
当座預金残高	3,863,100	3,876,600	3,870,600
準備預金残高	3,380,600	主な需給要因	
積み終了先	3,380,500		
超過準備	3,380,400		
非準備預金残高	482,500		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	60.0%		
乖離率	39.9%		

## 10月3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
国債買入(10/4~)						
1~3年	3,000	11,886	3,008	0.002	0.002	45.6
3~5年	3,500	10,836	3,506	0.001	0.001	49.3
5~10年	4,500	14,272	4,507	0.001	0.002	2.6
国債補完供給(10/3~10/4)						
	125,472	2,412	2,412	▲0.600	▲0.600	
	30,000	2	2	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
10月2日時点 5,016,700	今積期の所要準備額 2,992,200
	10月4日以降の残り所要積数 1,700
	平均 100

## 国庫短期証券入札予定

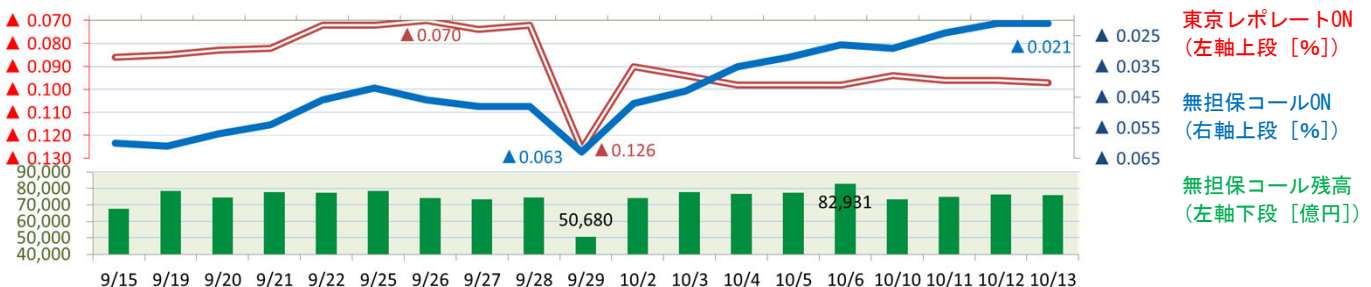
10月5日	3ヶ月	第787回
10月9日	6ヶ月	第788回
10月12日	3ヶ月	
10月18日	1年	
10月11日	30年	
10月16日	5年	
10月18日	20年	
10月25日	2年	

## 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	10月3日 4
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	3	10 17 24 26	10月3日 4
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	500~1,500 程度	500	5	12 19 24 30	9月27日 5
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	#VALUE!

## 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。