

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年10月4日(木)

短期市場の推移

	9月28日	10月1日	10月2日	10月3日
加重平均金利	▲0.064	▲0.063	▲0.062	▲0.060
東京レポレート(ON)	▲0.169	▲0.095	▲0.098	▲0.096
無コール残	54,181	83,422	88,736	86,520
ON	31,241	52,602	56,771	54,025
その他	22,940	30,820	31,965	32,495
有コール残	10,272	27,967	26,098	27,559

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5日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
10:00	営業毎旬報告(9月30日現在)	21:30	(米)9月非農業部門雇用者数 18.8万人
	-	21:30	(米)9月失業率 3.8%
	-		

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	▲0.083	0.001	▲0.057	▲0.097
T/N	-	-	0.000	▲0.106
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.034	0.001	▲0.020	▲0.106
2W	-	-	▲0.020	▲0.111
3W	-	-	-	▲0.117
1M	▲0.025	▲0.020	▲0.021	▲0.124
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.143
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、▲0.075%の出合から始まった。その後は主に▲0.080%~▲0.020%のレンジで取引された。昨日同様、地銀業態を中心に資金調達ニーズが強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.003%の▲0.057%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.083 ~ ▲0.080	▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.083 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

本日同様、資金調達ニーズは強いと想定されるため、堅調な地合となる見込み。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月4日	10月5日	10月4日	10月5日	10月9日	10月9日
券	▲900	▲400				+1,000
財政	+900	▲6,200				▲5,000
過不足	+0	▲6,600				▲4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国債買入		+11,000				
共通担保(全店)						
CP等買入			▲200			▲2,100
国債補完供給	+2,500	▲2,200	+2,200			
当座預金増減		+11,300		▲4,600		▲6,100
当座預金残高		3,874,400		3,869,800		3,863,700
準備預金残高		3,383,100	主な需給要因			
積み終了先		3,383,000				
超過準備		3,383,000				
非準備預金残高		491,300				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		63.3%				
乖離率		36.6%				

10月4日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
CP等買入(10/10~)	2,000	4,993	1,990	▲0.004	0.000	1.9
国債補完供給(10/4~10/5)	96,019	2,116	2,116	▲0.600	▲0.601	
	10,000	2	2	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース	所要
10月3日時点 4,956,800	今積期の所要準備額 2,992,200
	10月5日以降の残り所要積数 1,600
	平均 100

国庫短期証券入札予定

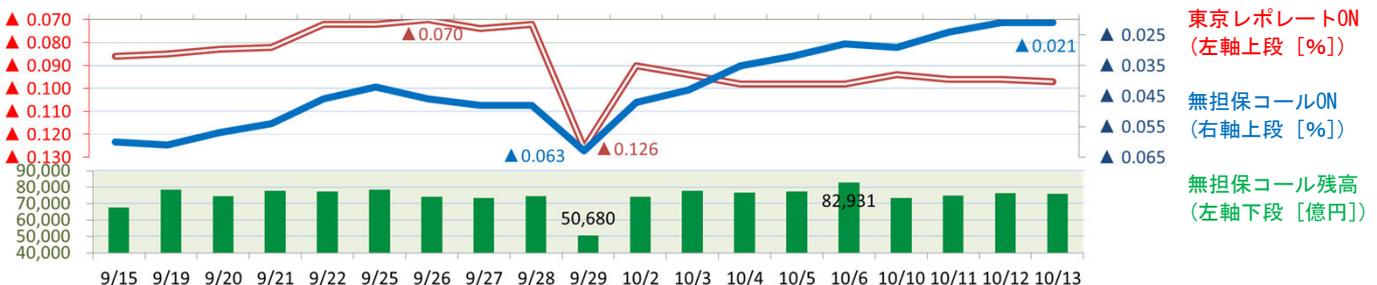
10月5日	3ヶ月	第787回
10月9日	6ヶ月	第788回
10月12日	3ヶ月	
10月18日	1年	
10月11日	30年	
10月16日	5年	
10月18日	20年	
10月25日	2年	

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。