

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年10月5日(金)

## 短期市場の推移

	10月1日	10月2日	10月3日	10月4日
加重平均金利	▲0.063	▲0.062	▲0.060	▲0.057
東京レポレート(ON)	▲0.095	▲0.098	▲0.096	▲0.097
無コール残	83,422	88,736	86,520	86,820
ON	52,602	56,771	54,025	53,425
その他	30,820	31,965	32,495	33,395
有コール残	27,967	26,098	27,559	26,053

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9日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	8月国際収支(経常収支)	18966億円	(米)NY連銀総裁の講演	
8:50	業種別・地域別直接投資(4~6月期)	-	15:00 (独)8月貿易収支	163億ユーロ
	-	-	15:00 (独)8月経常収支	-

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	▲0.080	0.001	▲0.051	▲0.095
T/N	-	-	0.000	▲0.106
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.015	▲0.109
2W	-	-	▲0.015	▲0.116
3W	-	-	-	▲0.119
1M	-	-	▲0.007	▲0.127
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、▲0.070%の出合から始まった。その後は主に▲0.070%~▲0.020%のレンジで取引される堅調な地合いとなった。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.005%の▲0.052%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.065		▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.075 ~ ▲0.015

## 翌営業日のマーケット

週明けも、しっかりと資金調達需要は継続すると思われるため、堅調な地合いとなろう。

## 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月5日	10月9日	10月9日	10月10日	10月10日	10月10日
券	▲300	+1,000	▲300	+1,000	▲300	+1,000
財政	▲5,900	▲1,300	▲5,900	▲1,300	▲5,900	▲1,300
過不足	▲6,200	▲300	▲6,200	▲300	▲6,200	▲300
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				+2,700		+2,700
共通担保(全店)		▲2,100		+1,400		+2,000
CP等買入	▲200	▲200	▲200	▲200	▲200	▲200
国債補完供給	+2,200	▲2,600	+2,200	▲2,600	+2,200	▲2,600
当座預金増減	▲6,800	+4,100	▲6,800	+4,100	▲6,800	+4,100
当座預金残高	3,867,600	3,871,700	3,867,600	3,871,700	3,867,600	3,871,700
準備預金残高	3,382,700		3,382,700		3,382,700	
積み終了先	3,382,600		3,382,600		3,382,600	
超過準備	3,382,600		3,382,600		3,382,600	
非準備先残高	484,900		484,900		484,900	
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%	
平均	76.7%		76.7%		76.7%	
乖離率	23.2%		23.2%		23.2%	

## 10月5日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(10/9~)						
10~25年	1,800	3,631	1,808	▲0.005	▲0.003	73.8
25年~	500	1,955	504	▲0.003	▲0.002	30.2
物価連動	250	1,454	251	▲0.060	▲0.062	96.4
国債補完供給(10/5~10/9)						
共通担保(全店)	65,688	2,558	2,558	▲0.600	▲0.600	
共通担保(全店)(10/9~10/22)	8,000	1,403	1,403			

マナタリーベース [億円]  
10月4日時点 4,969,000

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,003,300  
10月9日以降の残り所要積数 1,000  
平均 100

## 国庫短期証券入札予定

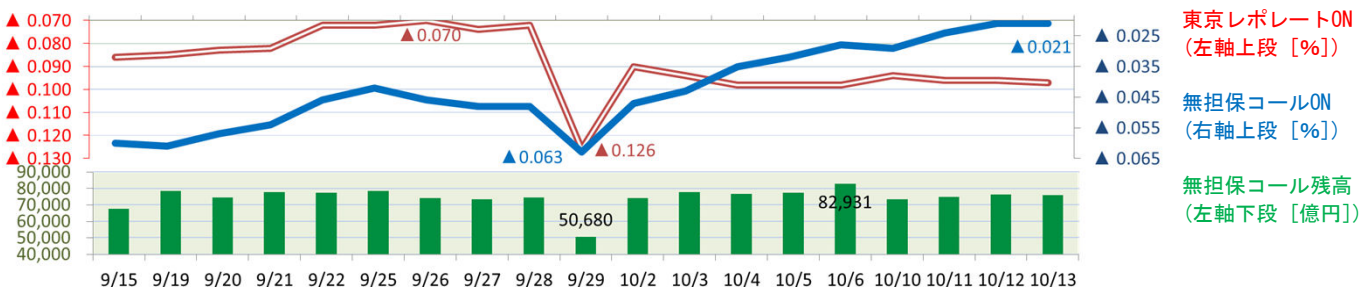
10月9日	6ヶ月	第788回
10月12日	3ヶ月	第789回
10月18日	1年	
10月19日	3ヶ月	
10月11日	30年	
10月16日	5年	
10月18日	20年	
10月25日	2年	

## 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	10月5日 4
物価連動債	250 程度	250	月2回程度		10月5日 1
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。