

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年10月9日(火)

短期市場の推移

[億円] [%]

	10月2日	10月3日	10月4日	10月5日
加重平均金利	▲0.062	▲0.060	▲0.057	▲0.051
東京レポレート(ON)	▲0.098	▲0.096	▲0.097	▲0.095
無コール残	88,736	86,520	86,820	84,999
ON	56,771	54,025	53,425	51,314
その他	31,965	32,495	33,395	33,685
有コール残	26,098	27,559	26,053	27,827

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10日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	8月機械受注 [前月比]	▲4.0%	IMF世界金融安定性報告 (インドネシア)	
	-		NY連銀総裁の講演 (インドネシア)	
21:30	-		(米)9月生産者物価 コア指数[前年比]	2.7%

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	▲0.052	▲0.098
T/N	-	-	0.000	▲0.108
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	▲0.015	▲0.021	▲0.114
2W	-	-	▲0.010	▲0.119
3W	-	-	▲0.020	▲0.121
1M	-	-	-	▲0.129
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.180	▲0.144
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、▲0.030%の outage から始まった。その後は主に▲0.080%~▲0.020%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.052%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.070		▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.080 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

地銀業態を中心に資金調達需要は継続と思われるため、本日と同様の堅調な地合を予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報 10月9日	日銀予想 10月10日	当社需給予想 10月11日
券	+900	+800	+0
財政	+200	▲1,400	+3,000
過不足	+1,100	▲600	+3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+2,700		
共通担保(全店)	▲2,100	+1,400	
CP等買入	▲200	▲200	+2,000
国債補完供給	+2,600	▲1,300	+1,300
当座預金増減	+4,200	+2,500	+3,000
当座預金残高	3,871,800	3,874,300	3,877,300
準備預金残高	3,396,100	主な需給要因	
積み終了先	3,396,000	国庫短期証券 発行・償還 (6M)	
超過準備	3,396,000		
非準備先残高	475,700		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	80.0%		
乖離率	19.9%		

10月9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(10/9~10/10)	120,325	1,214	1,214	▲0.600	▲0.600	
	2,971	10	10	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
10月5日時点 4,962,500	今積期の所要準備額 3,003,300
	10月10日以降の残り所要積数 900
	平均 100

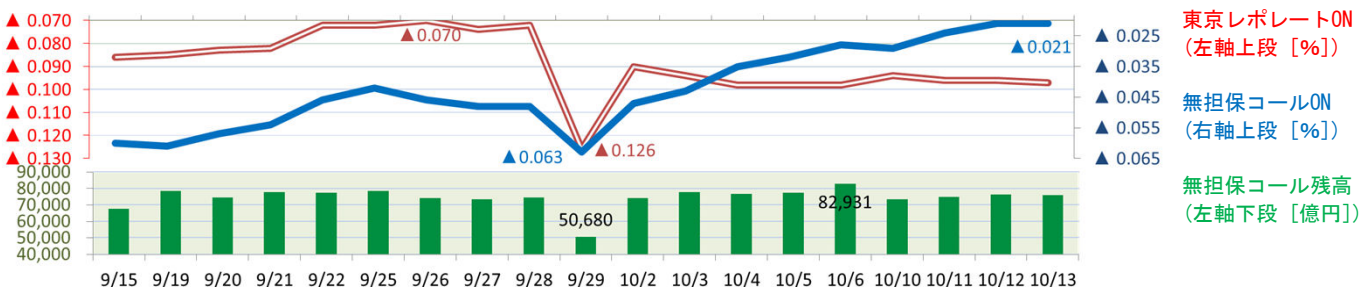
国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

国債入札予定	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
10月12日 3ヶ月 第789回	1年以下	100~1,000 程度	500	月2回程度	9月14日	2
10月18日 1年	1年超3年以下	2,000~4,000 程度	3,000			
10月19日 3ヶ月	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
10月26日 3ヶ月	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月11日 30年	10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
10月16日 5年	25年超	500~1,500 程度	500	5 12 19 24 30	10月5日	4
10月18日 20年	物価連動債	250 程度	250	月2回程度	10月5日	1
10月25日 2年	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。

上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会