

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年10月18日(木)

短期市場の推移

	10月12日	10月15日	10月16日	10月17日
加重平均金利	▲0.042	▲0.039	▲0.058	▲0.061
東京レポレート(ON)	▲0.106	▲0.099	▲0.104	▲0.109
無コール残	89,025	94,871	91,572	91,668
ON	58,260	64,736	60,237	59,083
その他	30,765	30,135	31,335	32,585
有コール残	21,846	22,796	16,363	18,643

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19日の予定(時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
8:30	9月消費者物価 コア指数[前年比]	+1.0%	(米)9月中古住宅 販売件数	
15:35	【挨拶】黒田総裁 (全国信用組合大会)	-	(米)アトランタ連銀 総裁講演	
			(中)7-9月期GDP [前年比]	6.6%

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	▲0.064	▲0.107
T/N	▲0.040	0.000	▲0.027	▲0.146
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.010	▲0.023	▲0.145
2W	-	-	▲0.035	▲0.145
3W	-	-	▲0.030	▲0.145
1M	▲0.030	▲0.025	▲0.030	▲0.145
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.200	▲0.150
6M	-	-	-	▲0.150
1Y	-	-	-	▲0.157

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▲0.086%~▲0.035%の幅広いレンジで取引された。昨日と比較すると弱含む展開となり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.03%の▲0.064%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.080		▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.086 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

ビッドサイドが弱い展開が予想されるため、本日対比弱含むか。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月18日	10月19日	10月18日	10月19日	10月22日	10月23日
券	▲1,100	▲600	▲1,100	▲600	▲1,100	▲600
財政	▲700	▲3,700	▲700	▲3,700	▲700	▲3,700
過不足	▲1,800	▲4,300	▲1,800	▲4,300	▲1,800	▲4,300
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		+12,400				
共通担保(全店)						
CP等買入	▲100		▲200		▲1,400	
社債等買入			▲300			
ETF買入		+100		+100		
被災地金融機関支援			▲100		+100	
国債補充供給	+1,300	▲1,700	+1,700			
当座預金増減	+10,200	▲3,000	+10,200	▲3,000	+10,200	▲3,000
当座預金残高	3,959,200	3,956,200	3,959,200	3,956,200	3,959,200	3,956,200
準備預金残高	3,461,100		3,461,100		3,461,100	
積み終了先	3,420,500		3,420,500		3,420,500	
超過準備	3,403,000		3,403,000		3,403,000	
非準備預金残高	498,100		498,100		498,100	
準備預金進捗率	98.0%		98.0%		98.0%	
平均	9.7%		9.7%		9.7%	
乖離率	88.3%		88.3%		88.3%	

10月18日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
社債等買入(10/24~)	1,000	2,103	1,000	▲0.039	▲0.018	48.6
国債補充供給(10/18~10/19)	13,635	1,656	1,656	▲0.600	▲0.600	

※米ドル資金供給は百万\$

国庫短期証券入札予定

10月19日	3ヶ月	第791回
10月26日	3ヶ月	
11月2日	3ヶ月	
11月8日	6ヶ月	
10月25日	2年	
11月1日	10年	
11月6日	物価運動	
11月13日	30年	

今月の国債買入オペ予定

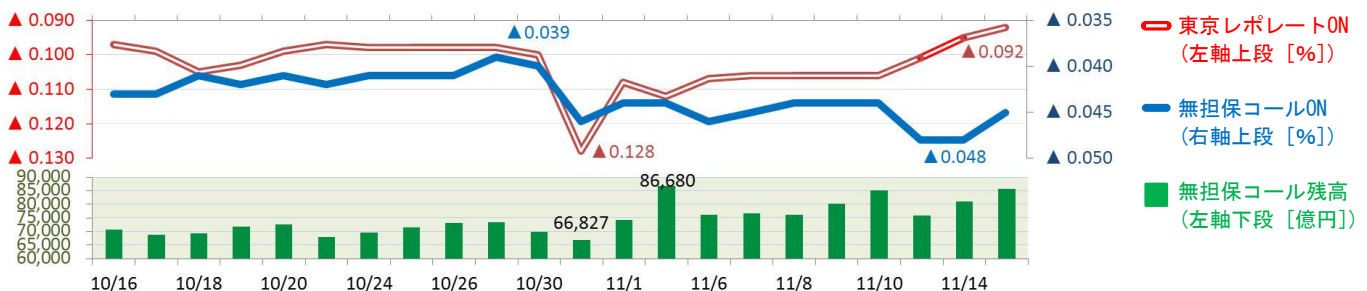
オペ種類	一回当たりオファー金額	直近オファー額	オファー予定日	直近日	残り回数	
1年以下	100~1,000 程度	500	月2回程度	10月10日	1	
1年超3年以下	2,000~4,000 程度	3,000				
3年超5年以下	2,500~4,500 程度	3,500	3/12/17	26/30	10月17日	2
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	3/10/17	24/26	10月17日	2
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800				
25年超	500~1,500 程度	500	5/12/19	24/30	10月12日	3
物価運動債	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	10月17日	0	

マナタリーベース [億円]
10月17日時点 5,042,000

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,103,600
10月19日以降の残り所要積数 62,200
平均 2,200

1年前の市場推移

○2017年10月積み期 [10月16日~11月15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