

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年10月23日(火)

短期市場の推移

	10月17日	10月18日	10月19日	10月22日
加重平均金利	▲0.061	▲0.064	▲0.068	▲0.069
東京レポレート(ON)	▲0.109	▲0.107	▲0.117	▲0.111
無コール残	91,668	91,287	93,552	86,436
ON	59,083	58,072	60,137	52,211
その他	32,585	33,215	33,415	34,225
有コール残	18,643	16,394	14,430	16,141

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24日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 預金種別店頭表示金利の平均年利率等	-	17:00 (欧)10月サービス業購買担当者指数(PMI)	54.5
-	-	20:00 (米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]	-
-	-	23:00 (米)9月新築住宅販売件数	63.0万戸

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	▲0.069	▲0.113
T/N	0.000	0.030	0.002	▲0.133
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.030	▲0.140
2W	▲0.030	▲0.010	▲0.023	▲0.143
3W	-	-	-	▲0.143
1M	-	-	-	▲0.144
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.001	▲0.150
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.158

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、▲0.080%の出合から始まり、その後は主に▲0.086%~▲0.030%のレンジで取引された。昨日対比参加者動向に大きな変化はなく、同加重平均金利(速報)も前営業日対比横ばいの▲0.069%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.085	▲0.085 ~ ▲0.085	▲0.085 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

引き続き軟調な地合が継続するものと予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月23日	10月24日	10月23日	10月24日	10月25日	10月26日
券	▲700	▲700	▲700	▲700	▲2,000	▲2,000
財政	▲1,900	▲7,300	▲1,900	▲7,300	+5,000	+5,000
過不足	▲2,600	▲8,000	▲2,600	▲8,000	+3,000	+3,000
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
国庫短期証券買入				+1,000		
CP等買入	▲100		▲100			
社債等買入				+1,000		
ETF買入	+400		+400			
ETF買入				+300		
国債補完供給	+2,600	▲2,500	+2,500			
当座預金増減	▲2,200	▲3,300	▲2,200	▲3,300	+3,000	+3,000
当座預金残高	3,949,100	3,945,800	3,949,100	3,945,800	3,948,800	3,948,800
準備預金残高	3,451,600		3,451,600			
積み終了先	3,449,100		3,449,100			
超過準備	3,448,900		3,448,900			
非準預先残高	497,500		497,500			
準備預金進捗率	99.6%		99.6%			
平均	25.8%		25.8%			
乖離率	73.8%		73.8%			

10月23日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国庫短期証券買入(10/24~)	1,000	5,404	1,000	0.005	0.008	47.9
米ドル資金供給(10/25~11/1)	0	0	2,700	2,700		
国債補完供給(10/23~10/24)	20,360	2,380	2,380	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース	所要
10月22日時点 5,045,800	今積期の所要準備額 3,103,600
	10月24日以降の残り所要積数 12,500
	平均 500

国庫短期証券入札予定

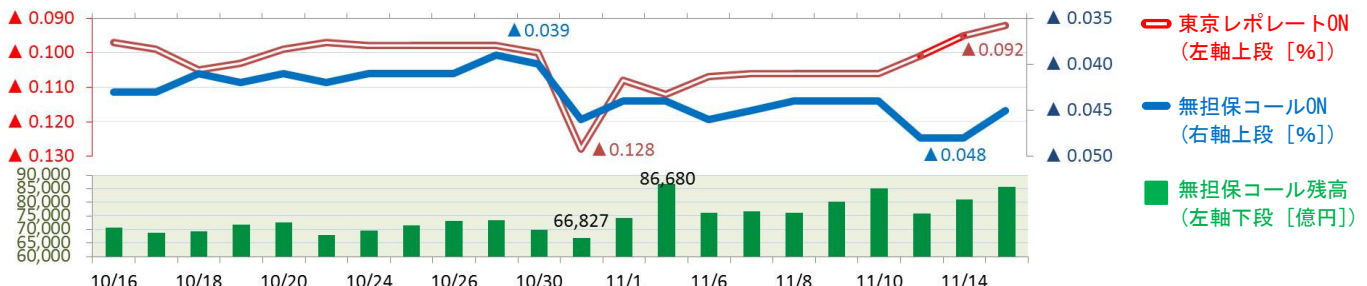
10月26日	3ヶ月	第792回
11月2日	3ヶ月	
11月8日	6ヶ月	
11月9日	3ヶ月	
10月25日	2年	
11月1日	10年	
11月6日	物価運動	
11月13日	30年	

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 12 17	26 30	10月17日	2
3年超5年以下	2,500~4,500 程度	3,500	3 10 17	24 26	10月17日	2
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	5 12 19	24 30	10月19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				
物価運動債	250 程度	250	月2回程度	10月19日	0	
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	10月17日	0	

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(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会