

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年10月24日(水)

短期市場の推移

	10月18日	10月19日	10月22日	10月23日
加重平均金利	▲0.064	▲0.068	▲0.069	▲0.069
東京レポレート(ON)	▲0.107	▲0.117	▲0.111	▲0.113
無コール残	91,287	93,552	86,436	90,039
ON	58,072	60,137	52,211	56,654
その他	33,215	33,415	34,225	33,385
有コール残	16,394	14,430	16,141	17,981

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25日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	企業向けサービス 価格指数(9月)	-	20:45	(欧)ECB理事会	0.0%
	【講演】若田部副総裁	-	21:30	(米)新規失業保険 申請件数[前週分]	-
	-	-	21:30	(米)9月耐久財受注 [前月比]	-1.0%

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	0.030	▲0.057	▲0.121
T/N	-	-	0.000	▲0.139
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.035	▲0.144
2W	▲0.027	▲0.010	▲0.015	▲0.144
3W	-	-	-	▲0.145
1M	-	-	-	▲0.145
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.151
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。試取りの動きから、プラス圏の出合がみられたことで、同加重平均金利(速報)は大幅上昇し、前営業日対比+0.012%の▲0.057%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.080	▲0.085 ~ ▲0.080	▲0.086 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

試取りの影響が剥落して、再び軟調な地合で取引されると予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月24日	10月25日	10月25日	10月26日	10月26日	10月27日
券	▲700	▲1,600	▲1,600	▲2,000	▲2,000	▲2,000
財政	▲7,300	+2,200	+2,200	+3,000	+3,000	+3,000
過不足	▲8,000	+600	+600	+1,000	+1,000	+1,000
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				
国債買入				+7,900		
CP等買入	▲100		▲200			
社債等買入		+1,000				
ETF買入		+300		+900		
国債補完供給	+2,500	▲800	+800			
当座預金増減	▲4,100	+10,000	+10,000	+1,000	+1,000	+1,000
当座預金残高	3,945,000	3,955,000	3,955,000	3,956,000	3,956,000	3,956,000
準備預金残高	3,434,400					
積み終了先	3,433,200					
超過準備	3,432,600					
非率預先残高	510,600					
準備預金進捗率	99.7%					
平均	29.0%					
乖離率	70.6%					

10月24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(10/25~)						
~1年	500	2,156	502	0.005	0.006	82.4
5~10年	4,500	7,649	4,501	▲0.013	▲0.009	11.1
10~25年	1,800	5,868	1,809	▲0.016	▲0.014	8.9
25年~	500	1,599	504	▲0.015	▲0.014	30.1
国債補完供給(10/24~10/25)						
	21,295	726	726	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース	所要
10月23日時点 5,044,300	今積期の所要準備額 3,103,600
	10月25日以降の残り所要積数 10,700
	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24日	0
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24日	1
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24日	1
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(登録)第243号 加入協会 日本証券業協会