

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年10月25日(木)

短期市場の推移

	10月19日	10月22日	10月23日	10月24日
加重平均金利	▲0.068	▲0.069	▲0.069	▲0.057
東京レポレート(ON)	▲0.117	▲0.111	▲0.113	▲0.121
無コール残	93,552	86,436	90,039	103,314
ON	60,137	52,211	56,654	66,479
その他	33,415	34,225	33,385	36,835
有コール残	14,430	16,141	17,981	14,100

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26日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:30 10月中旬の 東京都区部CPI		21:30 (米)7-9月期GDP 速報値 [前期比年率]	3.3%
-		-	
-		-	

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	▲0.152
T/N	-	-	0.000	▲0.157
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.035	▲0.037	▲0.156
2W	▲0.010	0.350	0.080	▲0.151
3W	-	-	0.001	▲0.148
1M	-	-	-	▲0.149
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.151
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.159

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%~▲0.040%のレンジで取引された。試取りの要因が剥落したことや、昨日に引き続き軟調な地合となったことから同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.012%の▲0.069%となった。

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

翌営業日のマーケット

引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25日	10月26日	10月26日	10月29日	10月29日
券	▲1,600	▲700	▲700	+0	+0
財政	+1,800	+200	+200	▲2,000	▲2,000
過不足	+200	▲500	▲500	▲2,000	▲2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	スタート
国債買入		+7,900			
共通担保(全店)				▲1,800	
CP等買入	▲200		▲200		
ETF買入	+900		+1,100		
国債補完供給	+800	▲700	+700		
当座預金増減	+8,900	+1,100	+1,100	▲3,800	
当座預金残高	3,953,900	3,955,000	3,955,000	3,951,200	
準備預金残高	3,455,800				
積み終了先	3,455,400				
超過準備	3,455,100				
非準備先残高	498,100				
準備預金進捗率	99.7%				
平均	32.3%				
乖離率	67.4%				

10月25日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債補完供給(10/25~10/26)						
	52,937	513	513	▲0.600	▲0.600	
	10,000	150	150	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース(億円)	所要(億円)
10月24日時点 5,040,900	今積期の所要準備額 3,103,600
	10月26日以降の残り所要積数 10,000
	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	
11月1日	10年	
11月6日	物価運動	
11月13日	30年	
11月15日	5年	

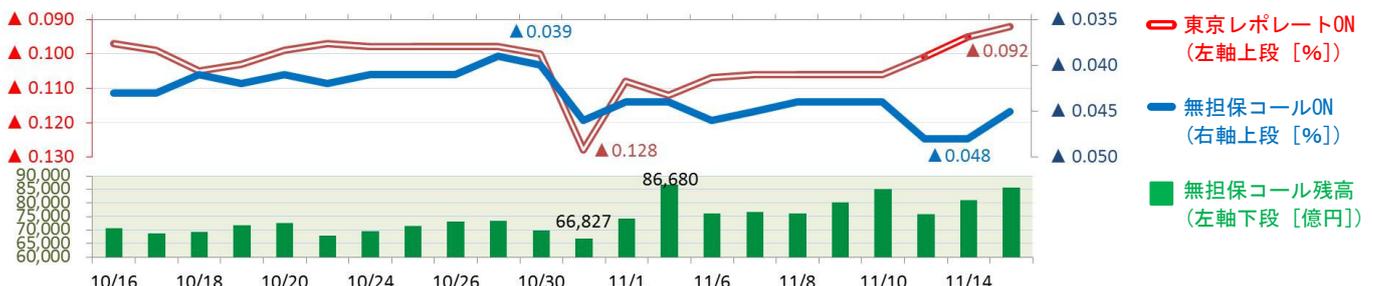
今月の国債買入オペ予定

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(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会