上田八木短資



デイリーシグナル

2023年10月17日(火)

短其	明市場の推	移			[億円] [%]
		10月11日	10月12日	10月13日	10月16日
加重平均金利		▲0.033	▲0.029	▲0.019	▲0.028
東京レボ レート(TN)		▲0.109	▲0.146	▲0.122	▲0.119
無	コール残	177,055	177,901	165,524	150,018
ON		104,007	104,953	95,876	84,185
	その他	73,048	72,948	69,648	65,833
有コール残		27,888	28,374	27,607	28,443

10月18日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想		海外	予想
)	-		21:30	(米)住宅着工件数 (9月)	
	-			-	
	-			-	

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 [%]

本日の短期市場金利

本日の市況

	無技	レポ市場		
	最低	最高	平均	東京レポ
				レート
O/N	▲0.087	0.001	▲0.015	▲0.096
T/N	-	-	-	▲0.107
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.018	▲0.027	▲0.147
2W	▲0.020	0.001	▲0.014	▲0.161
3W	-	-	-	▲0.169
1M	▲0.023	▲0.003	▲0.012	▲0.181
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.198
6M	-	-	-	▲0.127
1Y	-	-	-	▲0.087

無担保コールON物は▲0.015%の出合から始まり、その後は主に▲0.025%~▲0.005%の水準で 取引された。引き続きビッドサイドの資金調達意欲は強く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日 対比+0.013%の▲0.015%となった。

都銀・信託 証券 地銀 **▲** 0.040 ~ **▲** 0.040 \sim ▲ 0.035 \sim **▲** 0.005

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの資金調達意欲は底堅く、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

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

<u>資金需給</u>							
	日銀	速報	日銀	予想	当社需給予想		
	10月	17日	10月18日		10月	19日	
券		+100	▲400			▲ 1,000	
財政		+800		▲9,100	+5,000		
過不足		+900		▲9,500		+4,000	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	¥	スタート	
国庫短期証券買入				+1,000			
国債買入		+16,600					
CP等買入		+4,000	▲ 100				
社債等買入			▲300				
国債補完供給	+35,700	▲35,000	+35,000				

10月17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	莈札.	足切	平均 按分

国庫短期証券買入(10/18~)

1,000 6,017 1,001 0.017 0.021 92.2

国債買入(固定利回り方式)(10/18~) 0 0 5~10年

5~10年 米ドル資金供給(10/19~10/26)

3 3 5.580 5.580 国債補完供給(10/17~10/18)

35,552 35,552 ▲0.350 ▲0.351

0 0

金融調節 エンド スタート エンド	- AALN	1000		= 7,100			
国庫短期証券買入 国債買入 日債買入 上債等買入 国債補完供給 +35,700 ▲35,000 →300 日債補完供給 +35,700 ▲35,000 →	過不足	+900		▲9,500		+4,000	
国債買入	金融調節	エンド スタート		エンド	スタート	Ĭ	スタート
大人のの	国庫短期証券買入				+1,000		
社債等買入 国債補完供給 +35,700 ▲35,000 +35,000 +35,000 当座預金増減 +22,200 +26,100 +4,00 当座預金残高 5,478,300 5,504,400 5,508,40 準備預金残高 4,768,400 主な需給要因 積み終了先 4,690,600 積み終了先 4,283,900 事準預免残高 709,900 準備預金進捗率 97.5%	国債買入		+16,600				
国債補完供給 +35,700 ▲35,000 +35,000 当座預金増減 +22,200 +25,100 +4,00 当座預金残高 5,478,300 5,504,400 5,508,40 準備預金残高 4,768,400 主な需給要因 積み終了先 4,690,600 超過準備 4,283,900 非準預先残高 709,900 準備預金進捗率 97.5%	CP等買入		+4,000	▲100			
当座預金増減 +22,200 +26,100 +4,00 当座預金残高 5,478,300 5,504,400 5,508,40 準備預金残高 4,768,400 主な需給要因 積み終了先 4,690,600 国債発行(20年) 超過準備 4,283,900 非準預先残高 709,900 準備預金進捗率 97.5%	社債等買入			▲300			
当座預金残高 5,478,300 5,504,400 5,508,40	国債補完供給	+35,700	▲35,000	+35,000			
当座預金残高 5,478,300 5,504,400 5,508,40							
当座預金残高 5,478,300 5,504,400 5,508,40 準備預金残高 4,768,400 主な需給要因 積み終了先 4,690,600 国債発行 (20年) 超過準備 4,283,900 非準預先残高 709,900 準備預金進捗率 97.5%							
当座預金残高 5,478,300 5,504,400 5,508,40 準備預金残高 4,768,400 主な需給要因 積み終了先 4,690,600 国債発行 (20年) 超過準備 4,283,900 非準預先残高 709,900 準備預金進捗率 97.5%							
当座預金残高 5,478,300 5,504,400 5,508,40							
当座預金残高 5,478,300 5,504,400 5,508,40							
当座預金残高 5,478,300 5,504,400 5,508,40 準備預金残高 4,768,400 主な需給要因 積み終了先 4,690,600 国債発行 (20年) 超過準備 4,283,900 非準預先残高 709,900 準備預金進捗率 97.5%							
当座預金残高 5,478,300 5,504,400 5,508,40							
準備預金残高 4,768,400 主な需給要因 積み終了先 4,690,600 国債発行(20年) 超過準備 4,283,900 非準預先残高 709,900 準備預金進捗率 97.5%	当座預金増減		+22,200		+26,100		+4,000
積み終了先 4,690,600 国債発行(20年) 超過準備 4,283,900 非準預先残高 709,900 準備預金進捗率 97.5%	当座預金残高	5,478,300			5,504,400		5,508,400
超過準備 4,283,900 非準預先残高 709,900 準備預金進捗率 97.5%	準備預金残高	4,768,400		主な需		給要因	
非準預先残高 709,900 準備預金進捗率 97.5%	積み終了先	4,690,600		国債発行(20年)			
準備預金進捗率 97.5%	超過準備	4,283,900					
	非準預先残高	709,900					
平均 6.5%	準備預金進捗率	97.5%					
1.3	平均	6.5%					
乖離率 91.1%	乖離率	91.1%					

マネタリーベース [億円] 10月16日時点 6,708,900

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,006,500
10月18日以降の残り所要	
積数	99,200
平均	3,400

	国 /里	<u>、化プル</u>
ľ	10月19日	1年 (第1189回)
	10月20日	3ヶ月(第1190回)
	10月27日	3ヶ月
	11月2日	3ヶ月
	国債入札予定	
ľ	10月30日	2年
ш		

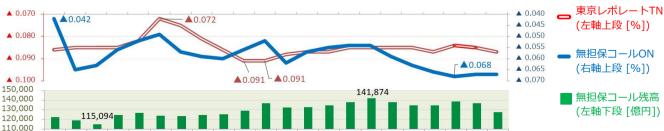
物価連動

11月7日

[億円] 今月の国債買入オペ予定 オペ種類 -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 月1回 1年以下 1500 1,500 10月4日 0 1年超3年以下 3,500~6,500 4,250 4 10 16 23 10月16日 4,000~7,500 3年超5年以下 4,500 4 16 23 27 10月16日 2 5年超10年以下 4,500~9,000 10 16 23 27 10月16日 6,750 10年超25年以下 1,000~5,000 10 23 27 2,000 10月10日 25年超 500~3,500 1,000 10 16 27 10月16日 物価連動債 600 月1回 9月27日 600 変動利付倩 300 48148

1年前の市場推移 ○2022年10月積み期 [10月14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。



10/1410/1710/1810/1910/2010/2110/2410/2510/2610/2710/2810/31 11/1 11/2 11/4 11/7 11/8 11/9 11/1011/1111/1411/15 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