

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年10月17日(水)

短期市場の推移

	10月11日	10月12日	10月15日	10月16日
加重平均金利	▲0.050	▲0.042	▲0.039	▲0.058
東京レポレート(ON)	▲0.100	▲0.106	▲0.099	▲0.104
無コール残	88,068	89,025	94,871	91,572
ON	57,413	58,260	64,736	60,237
その他	30,655	30,765	30,135	31,335
有コール残	21,090	21,846	22,796	16,363

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18日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
9:30頃 【挨拶】黒田総裁(支店長会議)	-	21:30 (米)新規失業保険申請件数[前週分]	-
14:00 地域経済報告(10月)	-	23:00 (米)9月中古住宅販売件数	532万件
14:00 関東甲信越地域業況判断DI(9月)	-	-	-

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	▲0.061	▲0.109
T/N	-	-	0.000	▲0.139
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	▲0.025	▲0.030	▲0.141
2W	▲0.035	▲0.025	▲0.031	▲0.146
3W	-	-	0.000	▲0.142
1M	▲0.023	▲0.015	▲0.016	▲0.144
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.070	▲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、▲0.07%の出合から始まり、その後は主に▲0.086%~▲0.03%の幅広いレンジで取引される展開となった。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.03%の▲0.061%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.073	▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.075 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

調達ニーズはやや減退してきており、本日対比横ばいか弱含む展開を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月17日	10月18日	10月18日	10月19日	10月19日	10月19日
券		▲200	▲1,100	▲1,000	▲1,000	
財政		▲20,500	+600	▲7,000	▲7,000	
過不足		▲20,700	▲500	▲8,000	▲8,000	
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			+12,400			
CP等買入	▲100		▲100			
ETF買入		+100	+100			
被災地金融機関支援				▲100	+100	
国債補完供給	+1,900	▲1,300	+1,300			
当座預金増減		▲19,100	+13,200	▲8,000	▲8,000	
当座預金残高		3,949,000	3,962,200	3,954,200	3,954,200	
準備預金残高		3,454,800	主な需給要因			
積み終了先		3,349,900				
超過準備		2,988,900				
非準預先残高		494,200				
準備預金進捗率		96.1%				
平均		6.5%				
乖離率		89.7%				

10月17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(10/18~)						
1~3年	3,000	10,966	3,009	0.002	0.003	18.0
3~5年	3,500	7,771	3,510	0.000	0.001	17.7
5~10年	4,500	12,353	4,517	0.000	0.001	36.8
変動利付	1,000	2,745	1,002	▲0.180	▲0.197	57.7
国債補完供給(10/17~10/18)						
56,719	1,273	1,273	▲0.600	▲0.600		
2,894	1	1	▲0.600	▲0.600		

マナターベース	所要
10月16日時点 5,060,900	今積期の所要準備額 3,103,600
	10月18日以降の残り所要積数 120,200
	平均 4.100

国庫短期証券入札予定

10月18日	1年	第790回
10月19日	3ヶ月	第791回
10月26日	3ヶ月	
11月2日	3ヶ月	
10月18日	20年	
10月25日	2年	
11月1日	10年	
11月6日	物価連動	

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
物価連動債	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

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。