

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年9月24日(火)

## 短期市場の推移

	9月17日	9月18日	9月19日	9月20日
加重平均金利	▲0.065	▲0.065	▲0.065	▲0.057
東京レポレート(ON)	▲0.063	▲0.058	▲0.067	▲0.088
無コール残	90,655	97,544	100,072	101,125
ON	60,560	66,079	67,177	69,210
その他	30,095	31,465	32,895	31,915
有コール残	23,051	23,453	22,275	21,039

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。

## 9月25日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	政策委員会・金融政策決定会合議事要旨(7月29・30日分)	-	-	日米首脳会談
10:00	営業毎旬報告(9月20日現在)	-	20:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]
10:30	【挨拶】政井審議委員(三重)	-	23:00	(米)8月新築住宅販売件数
				65.3万戸

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	▲0.080	0.001	▲0.059	▲0.074
T/N	-	-	-	▲0.082
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.040	▲0.109
2W	-	-	-	▲0.107
3W	-	-	-	▲0.109
1M	-	-	-	▲0.112
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.141
6M	-	-	-	▲0.168
1Y	-	-	-	▲0.180

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、▲0.065%の出合から始まり、その後は主に▲0.080%~▲0.035%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.059%となった。前営業日の無担保コール市場残高は10兆1,125億円と、2営業日連続で10兆円を超えた。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.065	▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.075 ~ ▲0.025

## 翌営業日のマーケット

ビッドサイドの姿勢は本日と変わらず、地合いは横ばいと予想する。

## 資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	9月24日	9月25日	9月26日
券	+300	+400	▲1,000
財政	▲9,700	▲1,200	▲3,000
過不足	▲9,400	▲800	▲4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+5,600	+8,200	スタート
共通担保(全店)	▲500	+3,100	▲800
CP等買入	▲600	-	▲100
社債等買入	+1,300	-	-
ETF買入	+800	-	-
国債補完供給	+500	+500	-
当座預金増減	+300	+7,000	▲4,000
当座預金残高	4,095,900	4,102,900	4,098,900
準備預金残高	3,579,900	主な需給要因	
積み終了先	3,578,700		
超過準備	3,578,700		
非準備先残高	516,000	国債発行(40年)	
準備預金進捗率	99.5%		
平均	30.0%		
乖離率	69.5%		

## 9月24日のオペ結果

9月24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	落札	足切	平均	接分
国債買入(9/25~)						
~1年	500	1,094	502	0.000	0.009	8.2
1~3年	4,000	12,634	4,004	▲0.011	▲0.009	49.3
3~5年	3,600	10,312	3,604	▲0.022	▲0.021	66.4
米ドル資金供給(9/26~10/3)			0	0	2.390	2.390
国債補完供給(9/24~9/25)			491	491	▲0.350	▲0.350

マナタリーベース [億円]	所要
9月20日時点 5,215,300	今積期の所要準備額 3,081,200
	9月25日以降の残り所要積数 14,400
	平均 700

## 国庫短期証券入札予定

9月27日	3ヶ月	第860回
10月4日	3ヶ月	
10月9日	6ヶ月	
10月11日	3ヶ月	
9月25日	40年	
9月27日	2年	
10月1日	10年	
10月10日	30年	

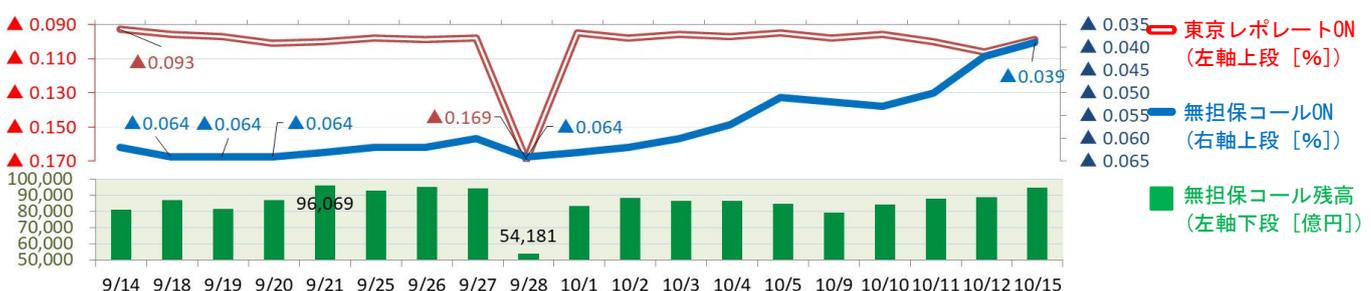
## 今月の国債買入オペ予定

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	9月24日	0
1年超3年以下	2,500~5,000 程度	4,000		9月24日	1
3年超5年以下	2,500~5,000 程度	3,600	6 17 24 30	9月24日	1
5年超10年以下	2,500~5,500 程度	3,800	6 12 20 26	9月20日	1
10年超25年以下	1,000~2,500 程度	1,200		9月20日	0
25年超	100~1,000 程度	300	2 12 20	9月20日	0
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	9月6日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	月1回	8月5日	#VALUE!

## 1年前の市場推移

○2018年9月積み期 [9月14日~10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。