

# DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年10月10日(木)

## 短期市場の推移

[億円][%]

	10月4日	10月7日	10月8日	10月9日
加重平均金利	▲0.011	▲0.012	▲0.012	▲0.012
東京レポレート(ON)	▲0.049	▲0.046	▲0.050	▲0.064
無コール残	87,025	75,741	82,323	78,791
ON	63,065	52,766	59,673	56,011
その他	23,960	22,975	22,650	22,780
有コール残	20,585	19,700	19,936	18,137

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11日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	マネーストック(9月)	-	23:00	(米)10月ミシガン大学消費者信頼感指数速報	92.3
	-			(米)9月輸出入物価指数	-
	-			(米)ボストン連銀総裁の講演	-

f92rLn8GU

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	▲0.040	0.001	▲0.011	▲0.052
T/N	-	-	-	▲0.063
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.020	▲0.068
2W	-	-	▲0.005	▲0.078
3W	▲0.010	0.001	▲0.005	▲0.085
1M	-	-	-	▲0.096
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.171
6M	-	-	-	▲0.181
1Y	-	-	-	▲0.197

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▲0.010%の出合から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.005%の水準で取引された。旺盛な資金調達ニーズは昨日と同様であり、同加重平均金利(速報)は前日対比+0.001%の▲0.011%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.015	▲0.015 ~ ▲0.010	▲0.015 ~ ▲0.005

## 翌営業日のマーケット

連休前の4日積みとなるため、本日と同様の堅調な地合いは継続と予想。

## 資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	10月10日	10月11日	10月11日	10月11日	10月15日
券	▲1,200	▲700	▲700	▲700	+1,000
財政	▲6,400	▲8,000	▲8,000	▲8,000	+83,000
過不足	▲7,600	▲8,700	▲8,700	▲8,700	+84,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)					▲2,200
CP等買入	▲100		▲400		
ETF買入				+700	
当座預金増減	▲7,700	▲8,400	▲8,400	▲8,400	+81,800
当座預金残高	4,001,300	3,992,900	3,992,900	3,992,900	4,074,700
準備預金残高	3,483,500		3,483,500		
積み終了先	3,483,300		3,483,300		
超過準備	3,483,300		3,483,300		
非準備預先残高	517,800		517,800		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		
平均	83.3%		83.3%		
乖離率	16.6%		16.6%		

10月10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
国債補完供給(10/10~10/11)		5	5	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]  
10月9日時点 5,126,100

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,090,800  
10月11日以降の残り所要積数 500  
平均 100

## 国庫短期証券入札予定

10月11日	3ヶ月	第863回
10月17日	1年	第864回
10月18日	3ヶ月	
10月25日	3ヶ月	
10月17日	5年	
10月24日	20年	
10月29日	2年	
11月6日	10年	

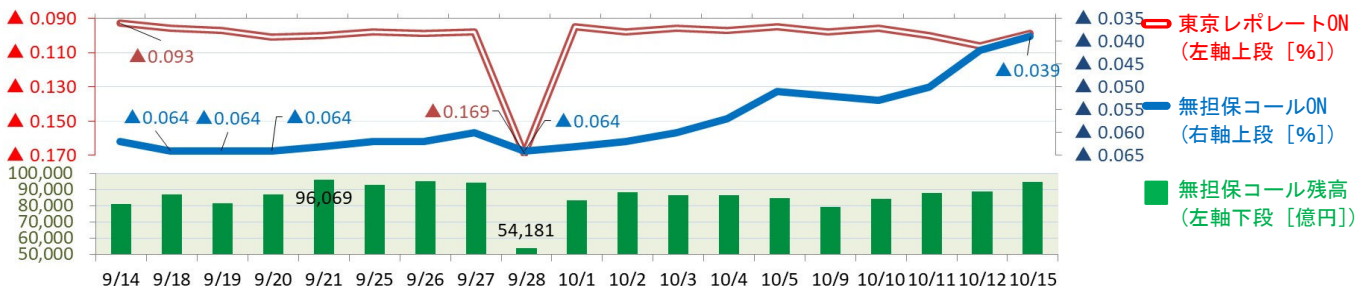
## 今月の国債買入オペ予定

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4日	1
1年超3年以下	3,000~5,500 程度	4,200	7 15 21 28	10月7日	3
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	4 15 21 28	10月4日	3
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	7 18 30	10月7日	2
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200			
25年超	0~500 程度	300			
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	10月4日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	月1回	8月5日	1

## 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。

上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会