

# DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年10月15日(火)

## 短期市場の推移

	10月8日	10月9日	10月10日	10月11日
加重平均金利	▲0.012	▲0.012	▲0.011	▲0.010
東京レポレート(ON)	▲0.050	▲0.064	▲0.052	▲0.054
無コール残	82,323	78,791	79,320	68,271
ON	59,673	56,011	56,495	45,601
その他	22,650	22,780	22,825	22,670
有コール残	19,936	18,137	18,191	19,627

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16日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
17:00	業態別の日銀当座預金残高(9月)	20:00	(米)MBA住宅ローン申請指数[前週比]
	-		シカゴ連銀総裁の講演
	-		(米)F&D

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	▲0.050	0.001	▲0.009	▲0.076
T/N	-	-	-	▲0.093
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.095
2W	▲0.030	0.000	▲0.020	▲0.094
3W	-	-	0.000	▲0.098
1M	-	-	-	▲0.104
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.169
6M	-	-	-	▲0.181
1Y	-	-	-	▲0.196

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%の割合から始まり、その後は主に▲0.015%~▲0.005%の水準で取引された。積み最終日となることから資金調達ニーズは昨日よりも強く、同加重平均金利(速報)は前日対比+0.001%の▲0.009%と、2016年4月14日(▲0.005%)以来約3年半ぶりの高水準となった。

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

## 翌営業日のマーケット

新積み期に入り、ビッドサイドは慎重な調達姿勢になり、本日対比で出合水準の低下を予想。

## 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月15日	10月16日	10月16日	10月17日	10月17日	10月17日
券		+400	+500	▲1,000		
財政		+84,500	+1,300	+1,000		
過不足		+84,900	+1,800	+0		
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
国債買入			+12,400			
共通担保(全店)	▲2,200	+2,200				+2,500
CP等買入	▲500		▲100			
ETF買入			+700			
国債補完供給		▲100	+100			
当座預金増減		+84,300	+14,900	+2,500		
当座預金残高		4,076,900	4,091,800	4,094,300		
準備預金残高		3,566,000	主な需給要因			
積み終了先		3,566,000				
超過準備		3,565,900				
非準備預金残高		510,900				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		100.0%				
乖離率		0.0%				

## 10月15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(10/16~)						
1~3年	4,200	15,344	4,205	0.008	0.009	14.3
3~5年	3,400	10,665	3,400	0.005	0.006	30.4
5~10年	3,500	6,107	3,507	0.002	0.004	68.9
変動利付	1,000	3,413	1,001	▲0.210	▲0.236	21.9
国債補完供給(10/15~10/16)						
		97	97	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]  
10月11日時点 5,111,700

所要 [億円]  
来積期の所要準備額 3,194,000  
10月16日以降の残り所要  
積数 3,194,000  
平均 103,000

## 国庫短期証券入札予定

10月17日	1年	第864回
10月18日	3ヶ月	第865回
10月25日	3ヶ月	
11月1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	

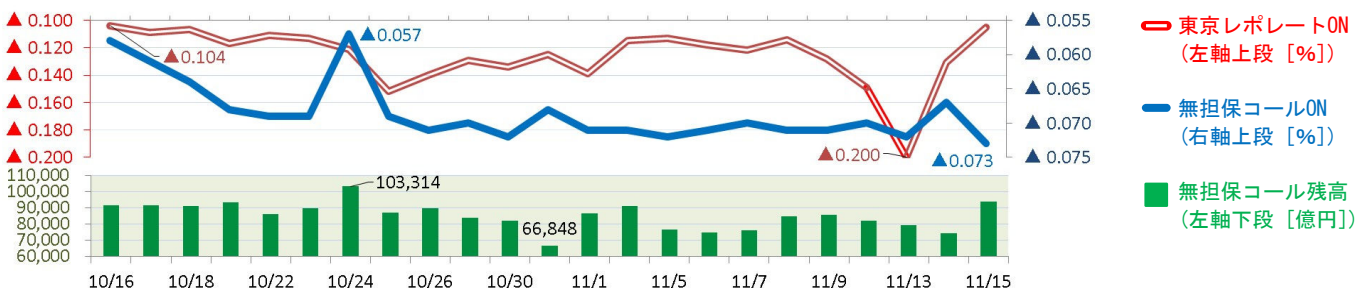
## 今月の国債買入オペ予定

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			
3年超5年以下	2,000~4,500 程度	3,400	7 15 21 28	10月15日	2
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	4 15 21 28	10月15日	2
10年超25年以下	500~2,000 程度	1,200			
25年超	0~500 程度	300	7 18 30	10月7日	2
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	10月15日	0

## 1年前の市場推移

○2018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(登録)第243号 加入協会 日本証券業協会