

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年10月16日(水)

短期市場の推移

	10月9日	10月10日	10月11日	10月15日
加重平均金利	▲0.012	▲0.011	▲0.010	▲0.009
東京レポレート(ON)	▲0.064	▲0.052	▲0.054	▲0.076
無コール残	78,791	79,320	68,271	73,689
ON	56,011	56,495	45,601	51,009
その他	22,780	22,825	22,670	22,680
有コール残	18,137	18,191	19,627	19,816

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17日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
13:00	9月の首都圏マンション販売	21:30	(米)新規失業保険申請件数(前週分)
			(米)ウィリアムズNY連銀 総裁の講演
			(米)G20財務省・中央銀行 総裁会議(18日まで)

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	▲0.051	▲0.094
T/N	-	-	-	▲0.093
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.020	▲0.032	▲0.092
2W	▲0.035	0.000	▲0.022	▲0.092
3W	-	-	-	▲0.098
1M	▲0.030	▲0.015	▲0.024	▲0.102
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.162
6M	-	-	-	▲0.180
1Y	-	-	-	▲0.195

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▲0.050%の出合から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.035%の水準で取引された。積み初日ということもありビッドサイドは慎重な調達姿勢となり、同加重平均金利(速報)は前日対比▲0.042%の▲0.051%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.060 ~ ▲0.050	▲0.075 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達姿勢に変化はなく、横ばい圏での取引を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月16日	10月17日	10月17日	10月18日	10月18日	10月19日
券	+500	▲900	▲900	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲2,700	+0	+0	▲11,000	▲11,000	▲11,000
過不足	▲2,200	▲900	▲900	▲12,000	▲12,000	▲12,000
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		▲400	+2,500		
ETF買入		+700		+100		
被災地金融機関支援					▲100	
国債補完供給	+100					
当座預金増減	+10,900	+2,300	+2,300	▲12,100	▲12,100	▲12,100
当座預金残高	4,087,800	4,090,100	4,090,100	4,078,000	4,078,000	4,078,000
準備預金残高	3,547,300					
積み終了先	1,717,100					
超過準備	938,900					
非準備先残高	540,500					
準備預金進捗率	81.7%					
平均	3.2%					
乖離率	78.4%					

10月16日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国庫短期証券買入(10/17~)	1,000	10,610	1,000	0.040	0.040	
米ドル資金供給(10/18~10/25)		0	0	2.340	2.340	
国債補完供給(10/16~10/17)		1	1	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース	所要
10月15日時点 5,195,700	今積期の所要準備額 3,194,000
	10月17日以降の残り所要積数 585,600
	平均 19,500

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	

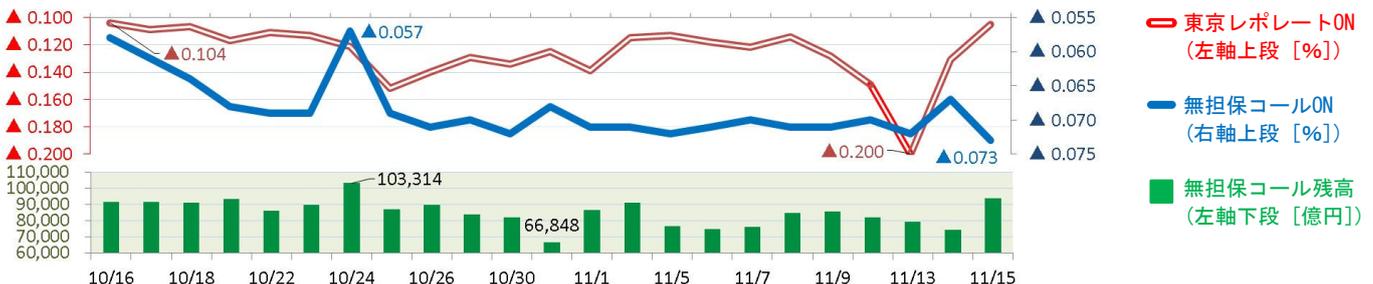
今月の国債買入オペ予定

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。