

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年10月17日(木)

## 短期市場の推移

	10月10日	10月11日	10月15日	10月16日
加重平均金利	▲0.011	▲0.010	▲0.009	▲0.051
東京レポレート(ON)	▲0.052	▲0.054	▲0.076	▲0.094
無コール残	79,320	68,271	73,689	80,007
ON	56,495	45,601	51,009	58,112
その他	22,825	22,670	22,680	21,895
有コール残	18,191	19,627	19,816	19,771

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
8:30	9月消費者物価コア指数 [前年比]	+0.3%	17:00	(欧)8月経常収支	-
	月例経済報告(内閣府)		23:00	(米)9月景気先行指数	0.1%

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	▲0.070	0.001	▲0.045	▲0.083
T/N	-	-	-	▲0.077
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.035	▲0.078
2W	▲0.028	▲0.010	▲0.024	▲0.083
3W	-	-	▲0.015	▲0.089
1M	▲0.030	▲0.025	▲0.026	▲0.095
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.159
6M	-	-	-	▲0.179
1Y	-	-	-	▲0.194

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▲0.055%~▲0.035%の水準で取引された。積み序盤であったが昨日と比べ、ビッドサイドの調達は旺盛であり、同加重平均金利(速報)は前日対比+0.006%の▲0.045%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.055 ~ ▲0.035

## 翌営業日のマーケット

週末3日積みとなるため、堅調な地合になると予想。

## 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17日	10月18日	10月21日	10月21日
券	▲1,000	▲1,200				+0
財政	+300	▲10,900				+2,000
過不足	▲700	▲12,100				+2,000
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				
共通担保(全店)					▲1,600	
CP等買入	▲400	+2,500	▲200			
社債等買入			▲100			
ETF買入		+100		+1,200		
被災地金融機関支援			▲100	+100		
国債補充供給	▲300		+300			
当座預金増減	+2,200	▲10,900				+400
当座預金残高	4,090,000	4,079,100				4,079,500
準備預金残高	3,570,300					
積み終了先	3,485,100					
超過準備	3,102,200					
非準備預金残高	519,700					
準備預金進捗率	96.3%					
平均	6.5%					
乖離率	89.9%					

## 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
社債等買入(10/24~)	1,250	2,381	1,251	▲0.048	▲0.040	87.5
国債補充供給(10/17~10/18)	296	296	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [億円]  
10月16日時点 5,206,100

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,194,000  
10月18日以降の残り所要積数 117,500  
平均 4.100

## 国庫短期証券入札予定

10月18日	3ヶ月	第865回
10月25日	3ヶ月	
11月1日	3ヶ月	
11月7日	6ヶ月	
10月24日	20年	
10月29日	2年	
11月6日	10年	
11月8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。