

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年10月28日(月)

## 短期市場の推移

	10月21日	10月23日	10月24日	10月25日
加重平均金利	▲0.019	▲0.014	▲0.013	▲0.014
東京レポレート(ON)	▲0.077	▲0.077	▲0.075	▲0.065
無コール残	76,227	74,424	74,946	77,374
ON	52,242	50,854	50,816	53,524
その他	23,985	23,570	24,130	23,850
有コール残	19,457	19,268	19,093	19,354

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29日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:30 東京都部 消費者物価指数 (総務省)	-	23:00 (米)10月消費者信頼感指数	127.8
-	-	-	-
-	-	-	-

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	▲0.060	0.001	▲0.016	▲0.063
T/N	-	-	-	▲0.057
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.025	▲0.060
2W	-	-	▲0.018	▲0.062
3W	-	-	-	▲0.071
1M	-	-	-	▲0.079
2M	-	-	-	-
3M	▲0.030	0.000	▲0.026	▲0.129
6M	-	-	0.040	▲0.173
1Y	-	-	-	▲0.192

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▲0.015%の出合から始まり、その後は主に▲0.02%~▲0.01%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前日対比▲0.002%の▲0.016%となった。

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

## 翌営業日のマーケット

本日対比で地合は弱含むと予想する。

## 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月28日	10月29日	10月29日	10月30日	10月30日	10月31日
券		+300		▲200		▲1,000
財政		+13,500		▲6,100		▲2,000
過不足		+13,800		▲6,300		▲3,000
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
国債買入				+11,700		
共通担保(全店)	▲2,200	+3,900				
CP等買入			▲100			
ETF買入				+100		
国債補完供給	+200					
当座預金増減		+15,700		+5,400		▲3,000
当座預金残高		4,102,400		4,107,800		4,104,800
準備預金残高		3,588,000				
積み終了先		3,586,200				
超過準備		3,586,200				
非準備預金残高		514,400				
準備預金進捗率		99.8%				
平均		41.9%				
乖離率		57.8%				

## 10月28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(10/29~)						
1~3年	4,200	9,648	4,212	0.018	0.019	94.2
3~5年	3,400	7,858	3,406	0.014	0.016	18.6
5~10年	3,500	7,791	3,514	0.013	0.015	43.0
物価連動	250	1,016	251	0.050	▲0.060	26.7
CP等買入(10/31~)						
	2,500	8,905	2,495	▲0.001	0.000	20.5
国債補完供給(10/28~10/29)						
		1	1	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]  
10月25日時点 5,209,400

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,194,000  
10月29日以降の残り所要積数 7,100  
平均 400

## 国庫短期証券入札予定

11月1日	3ヶ月	第867回
11月7日	6ヶ月	
11月8日	3ヶ月	
11月15日	3ヶ月	
10月29日	2年	
11月6日	10年	
11月8日	物価連動	
11月12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	10月21日	0
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28日	0
5年超10年以下	2,000~5,000 程度	3,500	4 15 21 28	10月28日	0
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18日	1
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	10月28日	0
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(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会