

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年10月30日(水)

## 短期市場の推移

	10月24日	10月25日	10月28日	10月29日
加重平均金利	▲0.013	▲0.014	▲0.016	▲0.021
東京レポレート(ON)	▲0.075	▲0.065	▲0.063	▲0.072
無コール残	74,946	77,374	75,521	77,200
ON	50,816	53,524	50,486	51,675
その他	24,130	23,850	25,035	25,525
有コール残	19,093	19,354	19,126	19,553

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31日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	9月鉱工業生産指数(前月比)	+0.4%	3:00	(米)10月連邦公開市場委員会(FOMC)政策金利	1.75%
-	10月日銀金融政策決定会合	-	19:00	(欧)7-9月期域内総生産(GDP)速報値(前年比)	1.0%
-	経済・物価情勢の展望(10月、基本的見解)	-	21:30	(米)9月個人所得	0.3%

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	▲0.024	▲0.073
T/N	-	-	-	▲0.068
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.020	▲0.025	▲0.067
2W	-	-	▲0.020	▲0.069
3W	-	-	-	▲0.075
1M	-	-	▲0.020	▲0.081
2M	-	-	0.010	-
3M	-	-	-	▲0.127
6M	-	-	-	▲0.171
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▲0.025%の出合から始まり、その後は主に▲0.03%~▲0.02%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前日対比▲0.003%の▲0.024%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.025	▲0.025 ~ ▲0.020	▲0.050 ~ ▲0.020

## 翌営業日のマーケット

月末要因で調達を控える先もあると想定されるため、本日よりも地合は弱含むと予想。

## 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	10月30日	10月31日	10月31日	11月1日	11月1日
券	▲400	▲1,000	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲1,300	▲400	▲400	▲25,000	▲25,000
過不足	▲1,700	▲1,400	▲1,400	▲26,000	▲26,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+1,000			
国債買入			+1,900		
CP等買入	▲100		▲1,300	+2,500	
ETF買入				+200	
国債補完供給	+100	▲100	+100		
当座預金増減	▲800	+2,000	▲26,000		
当座預金残高	4,108,300	4,110,300	4,084,300		
準備預金残高	3,572,100				
積み終了先	3,571,400				
超過準備	3,571,400				
非準備預金残高	536,200				
準備預金進捗率	99.8%				
平均	48.4%				
乖離率	51.5%				

## 10月30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(10/31~)						
10~25年	1,200	4,524	1,204	▲0.018	▲0.016	27.9
25年~	300	924	302	▲0.020	▲0.018	52.3
国債補完供給(10/30~10/31)						
		128	128	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]  
10月29日時点 5,231,700

所要	所要準備額
今積期の所要準備額	3,193,400
10月31日以降の残り所要積数	4,900
平均	300

## 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	
国債入札予定		
11月6日	10年	
11月8日	物価運動	
11月12日	30年	
11月14日	5年	

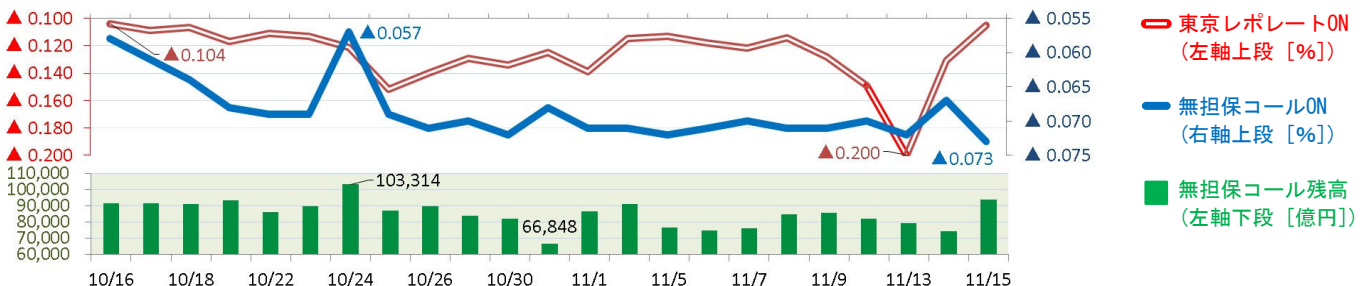
## 今月の国債買入オペ予定

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30日	0
物価運動債	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。