

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年10月2日(金)

短期市場の推移

	9月28日	9月29日	9月30日	10月1日
加重平均金利	▲0.032	▲0.031	▲0.061	▲0.031
東京レポレート(ON)	▲0.094	▲0.103	▲0.102	▲0.087
無コール残	109,736	117,692	80,838	94,129
ON	69,073	78,569	60,625	62,586
その他	40,663	39,123	20,213	31,543
有コール残	22,158	20,897	20,473	20,412

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5日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	日銀当座預金増減要因 (10月見込み)	-	米ISM非製造業総合 景況指数(9月)	
	-		ユーロ圏総合・サービス業 PMI(9月)	
	-		ユーロ圏小売売上高(8月)	

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	▲0.022	▲0.079
T/N	▲0.023	▲0.001	▲0.010	▲0.075
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.010	▲0.014	▲0.082
2W	▲0.035	0.001	▲0.021	▲0.088
3W	-	-	-	▲0.097
1M	-	-	▲0.035	▲0.106
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.125
6M	-	-	-	▲0.144
1Y	-	-	-	▲0.163

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▲0.020%の出合から始まり、その後は主に▲0.035%~▲0.015%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.009%の▲0.022%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.045 ~ ▲0.030	▲0.025 ~ ▲0.020	▲0.035 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

引き続き調達意欲は旺盛で、出合水準は概ね横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	10月2日	10月5日	10月6日
券		+0	+1,000
財政	▲72,300	▲28,500	+1,000
過不足	▲72,300	▲27,600	+2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+5,800	
共通担保(全店)		▲3,800	
CP等買入	▲300	▲400	
ETF買入		+200	
国債補完供給	+300		
米ドル資金供給用担保国債供給	+1,600		
当座預金増減	▲70,500	▲23,700	+2,000
当座預金残高	4,780,200	4,756,500	4,758,500
準備預金残高	4,195,300	主な需給要因	
積み終了先	4,195,200		
超過準備	4,195,200		
非準備預金残高	584,900	国庫短期証券	
準備預金進捗率	99.9%	発行・償還(3M)	
平均	63.3%		
乖離率	36.6%		

10月2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(10/5~)						
~1年	1,000	2,040	1,004	0.010	0.011	69.2
3~5年	3,500	9,952	3,507	0.000	0.001	22.8
10~25年	1,200	5,093	1,209	0.001	0.002	9.4
国債補完供給(10/2~10/5)						
共通担保(全店)(10/5~10/19)		0	0			
米ドル		0	0			
20,000	2,311	2,311				

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
10月1日時点 6,037,400	今積期の所要準備額 3,409,900
	10月5日以降の残り所要積数 100
	平均 0

国庫短期証券入札予定

10月8日	16ヶ月	第942回
10月9日	3ヶ月	第943回
10月16日	3ヶ月	
10月19日	1年	
10月6日	30年	
10月8日	5年	
10月20日	20年	
10月27日	2年	

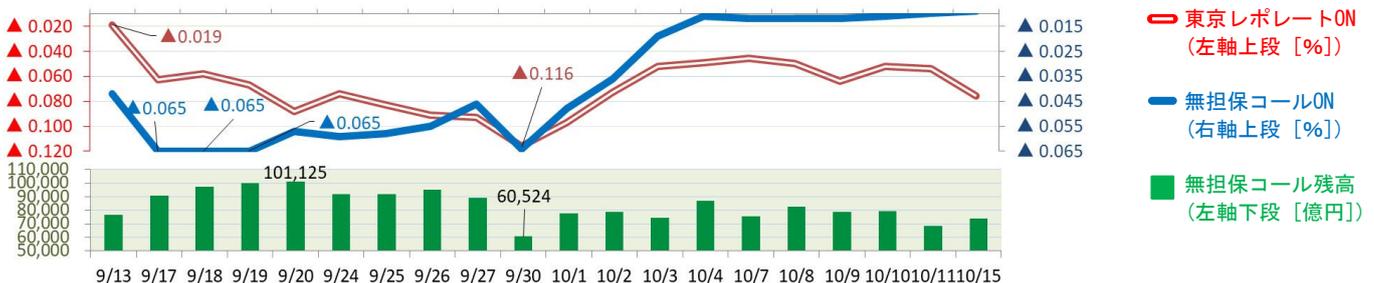
今月の国債買入オペ予定

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	500~1,500	1,000	月3回程度	10月2日	2
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	5 9 14 21 26 30	9月28日	6
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	2 7 14 21 23 30	10月2日	5
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	5 9 14 21 30	9月28日	5
10年超25年以下	500~2,000	1,200	2 26	10月2日	1
25年超	0~500	300	9 26	9月28日	2
物価連動債	300	300	月2回程度	9月28日	2
変動利付債<偶数月>	500	1,000	月1回	8月5日	1

1年前の市場推移

○2019年9月積み期 [9月13日~10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