

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年10月6日(火)

短期市場の推移

[億円][%]

	9月30日	10月1日	10月2日	10月5日
加重平均金利	▲0.061	▲0.031	▲0.022	▲0.019
東京レポレート(ON)	▲0.102	▲0.087	▲0.079	▲0.070
無コール残	80,838	94,129	102,935	87,549
ON	60,625	62,586	68,522	51,786
その他	20,213	31,543	34,413	35,763
有コール残	20,473	20,412	22,467	22,359

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7日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:00	営業毎旬報告 (9月30日現在)	-	(米) ミネアポリス 連銀総裁講演	
15:00	コール市場残高(9月)	-	(米) ニューヨーク 連銀総裁講演	

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	▲0.065	0.001	▲0.014	▲0.073
T/N	▲0.015	▲0.001	▲0.009	▲0.078
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.015	0.010	▲0.003	▲0.079
2W	-	-	▲0.025	▲0.086
3W	-	-	-	▲0.092
1M	-	-	-	▲0.099
2M	-	-	0.000	-
3M	-	-	-	▲0.121
6M	-	-	-	▲0.143
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▲0.015%の出合から始まり、その後は主に▲0.025%~▲0.010%の水準で出合が見られた。地合は昨日より強含み、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.005%の▲0.014%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.010	▲0.018 ~ ▲0.005	▲0.040 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

引き続き調達意欲は旺盛で、堅調な地合を想定。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月6日	10月7日	10月6日	10月7日	10月8日	10月9日
券	+1,100	+400	+1,100	+400	+0	+0
財政	+7,500	▲7,900	+7,500	▲7,900	+1,000	+1,000
過不足	+8,600	▲7,500	+8,600	▲7,500	+1,000	+1,000
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				+10,000		
国債買入		+8,500				
CP等買入	▲100					
社債等買入					+3,000	
ETF買入				+1,100		
国債補完供給	+400					
当座預金増減	+17,400	+3,600	+17,400	+3,600	+4,000	+4,000
当座預金残高	4,771,800	4,775,400	4,771,800	4,775,400	4,779,400	4,779,400
準備預金残高	4,203,800		4,203,800			
積み終了先	4,203,700		4,203,700			
超過準備	4,203,700		4,203,700			
非準備先残高	568,000		568,000			
準備預金進捗率	99.9%		99.9%			
平均	70.0%		70.0%			
乖離率	29.9%		29.9%			

10月6日のオペ結果 [%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

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(10/7~)	10,000	41,467	10,000	0.015	0.015	94.1
米ドル資金供給(10/8~10/16)		330	330	0.330	0.330	
米ドル資金供給(10/8~12/24)		0	0	0.330	0.330	
社債等買入(10/8~)	3,000	5,739	3,001	▲0.045	▲0.039	76.2
国債補完供給(10/6~10/7)		3	3	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
10月5日時点 5,940,200	今積期の所要準備額 3,409,900
	10月7日以降の残り所要積数 100
	平均 0

国庫短期証券入札予定

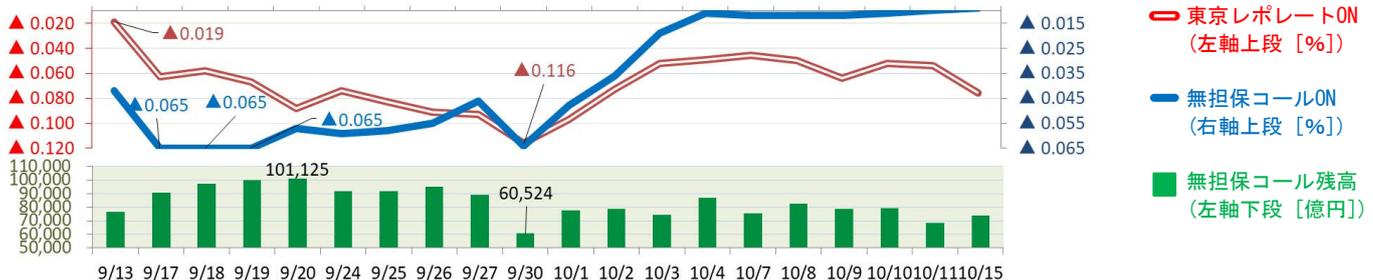
今月の国債買入オペ予定

10月8日 16ヶ月 第942回
10月9日 13ヶ月 第943回
10月16日 3ヶ月
10月19日 1年
国債入札予定
10月8日 5年
10月20日 20年
10月27日 2年
11月4日 10年

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	10月5日	5
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	10月5日	4
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