

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年10月8日(木)

短期市場の推移

[億円][%]

	10月2日	10月5日	10月6日	10月7日
加重平均金利	▲0.022	▲0.019	▲0.014	▲0.010
東京レポレート(ON)	▲0.079	▲0.070	▲0.073	▲0.071
無コール残	102,935	87,549	86,106	92,168
ON	68,522	51,786	48,093	52,855
その他	34,413	35,763	38,013	39,313
有コール残	22,467	22,359	22,497	21,197

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9日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	15:00 (英)8月国内総生産(GDP)[前月比]	-
-	-	15:00 (英)8月鉱工業生産指数[前月比]	-
-	-	-	-

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	▲0.055	0.001	▲0.008	▲0.079
T/N	▲0.025	▲0.001	▲0.015	▲0.080
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	▲0.005	▲0.008	▲0.079
2W	-	-	▲0.001	▲0.086
3W	-	-	-	▲0.091
1M	-	-	0.025	▲0.099
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.121
6M	-	-	-	▲0.142
1Y	-	-	-	▲0.162

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▲0.010%の出合から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.003%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+0.002%の▲0.008%と、2020年2月13日以来約8か月ぶりの高水準となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.008	▲0.008 ~ ▲0.005	▲0.010 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

積み終盤の3日積みということもあり、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 10月8日	日銀予想 10月9日	当社需給予想 10月12日
券	+0	+0	+1,000
財政	+1,500	▲27,600	▲10,000
過不足	+1,500	▲27,600	▲9,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+4,000		
CP等買入	▲200	▲400	
社債等買入	+3,000		
ETF買入	+400	+500	
国債補完供給	+500		
米ドル資金供給用担保国債供給		+2,200	
当座預金増減	+9,200	▲25,300	▲9,000
当座預金残高	4,783,800	4,758,500	4,749,500
準備預金残高	4,218,700	主な需給要因	
積み終了先	4,218,700		
超過準備	4,218,700		
非率預先残高	565,100	国債発行(5年)	国庫短期証券発行・償還(3M・6M)
準備預金進捗率	99.9%		
平均	76.7%		
乖離率	23.2%		

10月8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
国債補完供給(10/8~10/9)		11	11	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マナタリーベース [億円]
10月7日時点 5,958,900

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,421,200
10月9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9日	3ヶ月	第943回
10月16日	3ヶ月	
10月19日	1年	
10月22日	6ヶ月	
国債入札予定		
10月20日	20年	
10月27日	2年	
11月4日	10年	
11月6日	物価連動	

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7日	4
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	500	月1回	10月7日	-

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。