

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年10月12日(月)

短期市場の推移

[億円] [%]

	10月6日	10月7日	10月8日	10月9日
加重平均金利	▲0.014	▲0.010	▲0.008	▲0.008
東京レポレート(ON)	▲0.073	▲0.071	▲0.079	▲0.072
無コール残	86,106	92,168	95,044	97,051
ON	48,093	52,855	56,351	51,163
その他	38,013	39,313	38,693	45,888
有コール残	22,497	21,197	21,285	20,311

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13日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	マネーストック(9月)	-	21:30	(米)9月消費者物価コア指数[前年比]	1.8%

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

本日の市況

	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	▲0.016	▲0.064
T/N	-	-	▲0.001	▲0.068
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.077
2W	-	-	-	▲0.083
3W	-	-	-	▲0.089
1M	-	-	-	▲0.096
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.115
6M	-	-	-	▲0.138
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▲0.02%~▲0.005%の水準で出合が見られた。3日積み明け、一部調達意欲が後退したことから同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.008%の▲0.016%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.035 ~ ▲0.020	- ~ -	▲0.020 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

本日に引き続き調達姿勢に大きな変化はなく、出合水準は概ね横ばいを予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	10月12日	10月13日	10月14日
券	+600	+500	+0
財政	▲18,400	+400	▲8,000
過不足	▲17,800	+900	▲8,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+10,000		
CP等買入	▲200		
社債等買入		▲100	
ETF買入	+1,400		
国債補完供給	+200	▲100	+100
当座預金増減	▲6,500	+900	▲8,000
当座預金残高	4,751,000	4,751,900	4,743,900
準備預金残高	4,212,100	主な需給要因	
積み終了先	4,212,100		
超過準備	4,212,100		
非準備預金残高	538,900		
準備預金進捗率	100.0%	源泉税揚げ	
平均	90.0%		
乖離率	10.0%		

10月12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(10/12~10/13)	83	83	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
10月9日時点 5,941,800

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,421,200
10月13日以降の残り所要積数 0
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16日	3ヶ月	第944回
10月19日	1年	第945回
10月22日	6ヶ月	
10月23日	3ヶ月	
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9日	1
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	5 9 14 21 26 30	10月9日	4
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9日	3
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	10月9日	1
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。