

短期市場の推移

	10月7日	10月8日	10月9日	10月12日
加重平均金利	▲0.010	▲0.008	▲0.008	▲0.016
東京レポレート(ON)	▲0.071	▲0.079	▲0.072	▲0.064
無コール残	92,168	95,044	97,051	81,742
ON	52,855	56,351	51,163	44,754
その他	39,313	38,693	45,888	36,988
有コール残	21,197	21,285	20,311	20,751

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14日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		18:00 (欧)8月鉱工業生産指数 [前月比]	0.2%
		21:30 (米)9月生産者物価コア 指数 [前年比]	0.9%

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	▲0.020	▲0.069
T/N	-	-	▲0.001	▲0.082
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.079
2W	-	-	-	▲0.084
3W	-	-	-	▲0.091
1M	-	-	▲0.020	▲0.097
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.113
6M	-	-	-	▲0.140
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▲0.02%~▲0.008%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▲0.004%の▲0.020%となった。12日の無担保コールON物出来高は2020年1月6日以来9か月ぶりに4兆4,000億円台となり低調であった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.045 ~ ▲0.030	- ~ -	▲0.020 ~ ▲0.008

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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月13日	10月14日	10月13日	10月14日	10月13日	10月14日
券	+400	+400	+400	+400	+0	+0
財政	+3,900	▲1,400	▲1,400	▲1,400	+72,000	+72,000
過不足	+4,300	▲1,000	▲1,000	▲1,000	+72,000	+72,000
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				+25,000		
CP等買入			▲200		+6,000	
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+100	▲1,000	+1,000			
当座預金増減	+3,300	+24,800	+24,800	+24,800	+78,000	+78,000
当座預金残高	4,754,300	4,779,100	4,779,100	4,779,100	4,857,100	4,857,100
準備預金残高	4,206,700					
積み終了先	4,206,700					
超過準備	4,206,700					
非準預先残高	547,600					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	93.3%					
乖離率	6.7%					
			源泉税揚げ		年金定時払い	

10月13日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国庫短期証券買入(10/14~)	25,000	70,228	25,001	0.014	0.018	98.5
CP等買入(10/15~)	6,000	9,384	5,999	▲0.038	▲0.021	35.8
国債補完供給(10/13~10/14)						
	681	681	▲0.350	▲0.350		
	200	200	▲0.350	▲0.350		

マナターベース [億円]	所要 [億円]
10月12日時点 5,934,700	今積期の所要準備額 3,421,200
	10月14日以降の残り所要積数 0
	平均 0

国庫短期証券入札予定

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	

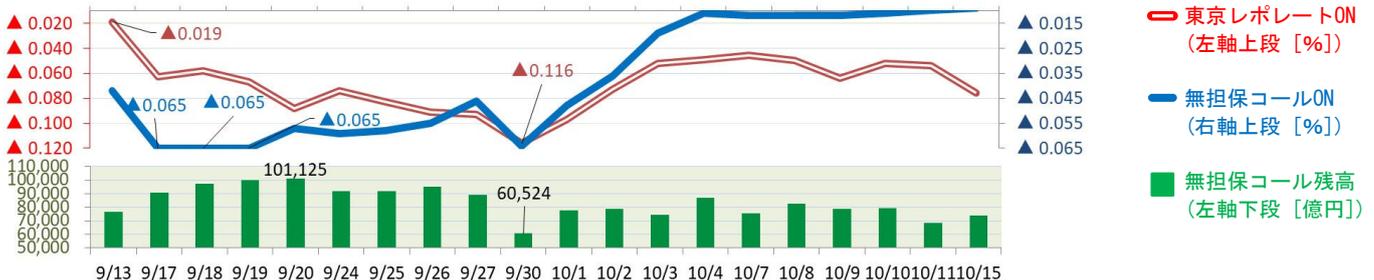
今月の国債買入オペ予定

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。 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