

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年10月14日(水)

短期市場の推移

	10月8日	10月9日	10月12日	10月13日
加重平均金利	▲0.008	▲0.008	▲0.016	▲0.020
東京レポレート(ON)	▲0.079	▲0.072	▲0.064	▲0.069
無コール残	95,044	97,051	81,742	81,831
ON	56,351	51,163	44,754	46,313
その他	38,693	45,888	36,988	35,518
有コール残	21,285	20,311	20,751	19,828

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15日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 (米)10月フィラデルフィア連銀製造業景況指数	15.0
-	-	21:30 (米)新規失業保険申請件数(前週分)	-
-	-	-	-

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	▲0.060	0.001	▲0.020	▲0.078
T/N	-	-	▲0.001	▲0.084
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.015	▲0.082
2W	▲0.025	0.010	▲0.014	▲0.084
3W	-	-	0.030	▲0.090
1M	▲0.020	0.013	0.008	▲0.097
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.113
6M	-	-	-	▲0.139
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▲0.030%~▲0.010%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比横這いの▲0.020%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.045 ~ ▲0.030	- ~ -	▲0.050 ~ ▲0.010

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14日	10月15日	10月15日	10月16日	10月16日	10月17日
券		+300	▲600	▲1,000		
財政		▲500	+71,200	▲3,000		
過不足		▲200	+70,600	▲4,000		
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				
国債買入				+12,300		
CP等買入	▲200		▲700	+6,000		
被災地金融機関支援					▲100	+100
国債補完供給	+1,000	▲100	+100			
当座預金増減		+25,500	+88,300	▲4,000		
当座預金残高		4,779,800	4,868,100	4,864,100		
準備預金残高		4,233,300	主な需給要因			
積み終了先		4,233,300				
超過準備		4,233,300				
非準預先残高		546,500				
準備預金進捗率		100.0%	年金定時払い			
平均		96.7%				
乖離率		3.3%				

10月14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
国債買入(10/15~)						
1~3年	4,200	10,614	4,201	0.001	0.002	64.5
3~5年	3,500	8,220	3,502	▲0.002	▲0.001	42.1
5~10年	4,200	14,490	4,210	▲0.003	▲0.002	43.8
物価連動	300	1,140	301	▲0.120	▲0.194	32.4
米ドル資金供給(10/16~10/22)						
		80	80	0.340	0.340	
米ドル資金供給(10/16~1/7)						
		0	0	0.330	0.330	
国債補完供給(10/14~10/15)						
		74	74	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
10月13日時点 5,937,600	今積期の所要準備額 3,421,200
	10月15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	

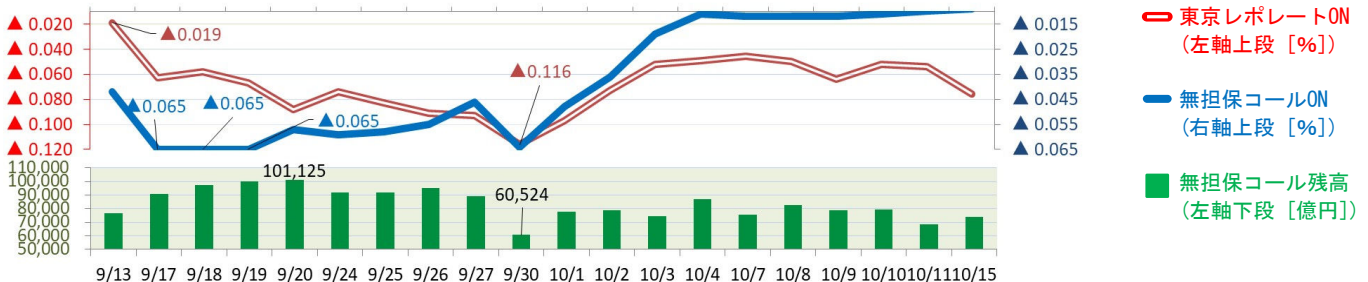
今月の国債買入オペ予定

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14日	3
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	2 7 14 21 23 30	10月14日	3
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	5 9 14 21 30	10月14日	2
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	10月14日	1
変動利付債<偶数月>	500	500	月1回	10月7日	0

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。