

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年10月15日(木)

## 短期市場の推移

	10月9日	10月12日	10月13日	10月14日
加重平均金利	▲0.008	▲0.016	▲0.020	▲0.020
東京レポレート(ON)	▲0.072	▲0.064	▲0.069	▲0.078
無コール残	97,051	81,742	81,831	88,045
ON	51,163	44,754	46,313	52,597
その他	45,888	36,988	35,518	35,448
有コール残	20,311	20,751	19,828	19,266

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16日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 (米)9月小売売上高	0.7%
-	-	22:15 (米)9月鉱工業生産指数[前月比]	0.7%
-	-	-	-

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	▲0.014	▲0.081
T/N	-	-	▲0.001	▲0.090
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	▲0.010	▲0.018	▲0.087
2W	▲0.020	0.015	▲0.008	▲0.087
3W	-	-	-	▲0.092
1M	▲0.025	▲0.020	▲0.023	▲0.099
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.115
6M	-	-	-	▲0.138
1Y	-	-	-	▲0.161

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▲0.020%~▲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+0.006%の▲0.014%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.015	- ~ -	▲0.050 ~ ▲0.005

## 翌営業日のマーケット

新積み期初日のためビッドサイドは慎重な動きとなり出合いの水準は低下すると予想。

## 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月15日	10月16日	10月15日	10月16日	10月15日	10月16日
券	▲700	+0	▲700	+0	▲700	+0
財政	+71,800	+700	+71,800	+700	+71,800	+700
過不足	+71,100	+700	+71,100	+700	+71,100	+700
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
国債買入	+12,300		+12,300		+12,300	
共通担保(全店)						
CP等買入	▲700	+6,000	▲300		▲2,300	
社債等買入			▲200			
被災地金融機関支援			▲100	+100		
国債補完供給	+100					
当座預金増減	+88,800	+200	+88,800	+200	+88,800	+200
当座預金残高	4,868,600	4,868,800	4,868,600	4,868,800	4,868,600	4,868,800
準備預金残高	4,313,000		4,313,000		4,313,000	
積み終了先	4,313,000		4,313,000		4,313,000	
超過準備	4,313,000		4,313,000		4,313,000	
非準備先残高	555,600		555,600		555,600	
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%	
平均	100.0%		100.0%		100.0%	
乖離率	0.0%		0.0%		0.0%	

## 10月15日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債補完供給(10/15~10/16)		0	0	0		

マネタリーベース [億円]  
10月14日時点 5,962,700

所要 [億円]  
来積期の所要準備額 3,537,500  
10月16日以降の残り所要積数 3,537,500  
平均 114,100

## 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	第946回
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10月積み期 [10月16日~11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。