

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年10月20日(火)

## 短期市場の推移

	10月14日	10月15日	10月16日	10月19日
加重平均金利	▲0.020	▲0.014	▲0.033	▲0.031
東京レポレート(ON)	▲0.078	▲0.081	▲0.083	▲0.074
無コール残	88,045	84,067	105,812	99,435
ON	52,597	50,574	72,189	62,822
その他	35,448	33,493	33,623	36,613
有コール残	19,266	20,601	20,932	21,053

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21日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
10:30 【挨拶】櫻井審議委員(福井)	-	(米)週間MBA住宅ローン申請指数	-
-	-	(米)ページブック	-
-	-	(米)クリーブランド連銀総裁講演	-

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	▲0.022	▲0.075
T/N	▲0.025	▲0.001	▲0.013	▲0.080
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	▲0.025	▲0.029	▲0.082
2W	-	-	-	▲0.086
3W	-	-	-	▲0.090
1M	▲0.015	▲0.010	▲0.012	▲0.097
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.111
6M	-	-	-	▲0.136
1Y	-	-	-	▲0.160

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券協会公表

## 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.020%の出合から始まり、その後は主に▲0.030%~▲0.013%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+0.009%の▲0.022%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.020	▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.040 ~ ▲0.013

## 翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲は強く、堅調な地合を予想。

## 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月20日	10月21日	10月21日	10月22日	10月22日	10月22日
券	▲300	▲600	▲600	+0		
財政	▲17,800	▲12,600	▲12,600	+2,000		
過不足	▲18,100	▲13,200	▲13,200	+2,000		
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
CP等買入	▲200	▲200	▲200			
社債等買入				+2,000		
国債補完供給	+200					
当座預金増減	▲18,100	▲13,400	▲13,400	+4,000		
当座預金残高	4,833,900	4,820,500	4,820,500	4,824,500		
準備預金残高	4,216,200	主な需給要因				
積み終了先	4,213,600	国債発行(20年)				
超過準備	4,213,400					
非率預先残高	617,700					
準備預金進捗率	99.8%					
平均	16.1%					
乖離率	83.7%					

## 10月20日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
米ドル資金供給(10/22~10/29)		30	30	0.340	0.340	
米ドル資金供給(10/22~1/14)		0	0	0.330	0.330	
社債等買入(10/22~)	2,000	3,124	2,001	0.103	0.127	61.6
国債補完供給(10/20~10/21)	2	2	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]  
10月19日時点 6,036,000

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,537,500  
10月21日以降の残り所要積数 7,800  
平均 300

## 国庫短期証券入札予定

10月22日	6ヶ月	第946回
10月23日	3ヶ月	第947回
10月30日	3ヶ月	
11月6日	3ヶ月	
10月27日	2年	
11月4日	10年	
11月6日	物価運動	
11月10日	30年	

## 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
物価運動債	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。 上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会