

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年10月22日(木)

短期市場の推移

	10月16日	10月19日	10月20日	10月21日
加重平均金利	▲0.033	▲0.031	▲0.022	▲0.019
東京レポレート(ON)	▲0.083	▲0.074	▲0.075	▲0.076
無コール残	105,812	99,435	103,217	104,219
ON	72,189	62,822	64,859	64,266
その他	33,623	36,613	38,358	39,953
有コール残	20,932	21,053	21,944	20,477

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23日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:30	9月消費者物価コア指数[前年比]	22:45	(米)10月製造業購買部担当者指数(PMI) 53.4
	-	22:45	(米)10月サービス業購買部担当者指数(PMI) 54.6
	-		-

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	▲0.017	▲0.090
T/N	▲0.020	▲0.001	▲0.012	▲0.091
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.015	▲0.022	▲0.087
2W	-	-	0.020	▲0.088
3W	-	-	-	▲0.091
1M	▲0.036	▲0.030	▲0.032	▲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業協会公表

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.015%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。堅調な地合は継続し、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.017%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.015	▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.030 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

週末3日積みのため、出合水準は本日対比で若干の上昇を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月22日	10月23日	10月23日	10月26日	10月26日	10月26日
券	▲1,600	▲800	▲800	+0	+0	+0
財政	+2,900	+14,000	+14,000	▲39,000	▲39,000	▲39,000
過不足	+1,300	+13,200	+13,200	▲39,000	▲39,000	▲39,000
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		+20,000				
国債買入		+12,600				
CP等買入	▲200		▲300			
社債等買入		+2,000	▲600			
国債補完供給	+100	▲300	+300			
新型コロナ対応金融支援特別				+27,600		
当座預金増減	+35,500	+40,200	+40,200	▲39,000	▲39,000	▲39,000
当座預金残高	4,855,600	4,895,800	4,895,800	4,856,800	4,856,800	4,856,800
準備預金残高	4,244,200	主な需給要因				
積み終了先	4,243,700					
超過準備	4,242,400					
非準備預金残高	611,400	国庫短期証券発行・償還(3M)				
準備預金進捗率	99.9%	国庫短期証券発行(6M)				
平均	22.6%					
乖離率	77.3%					

10月22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(10/22~10/23)	283	283	▲0.350	▲0.350		
新型コロナ対応金融支援特別(10/23~4/23)	0	0				
	27,560	27,560				

国庫短期証券入札予定

10月23日	3ヶ月	第947回
10月30日	3ヶ月	
11月6日	3ヶ月	
11月9日	6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21日	2
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	2 7 14 21 23 30	10月21日	2
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	5 9 14 21 30	10月21日	1
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21日	0
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