



デイリーシグナル

2021年10月6日(水)

短期市場の推移

	9月30日	10月1日	10月4日	10月5日
加重平均金利	▲0.049	▲0.018	▲0.017	▲0.015
東京レポレート(TN)	▲0.082	▲0.079	▲0.081	▲0.085
無コール残	103,650	142,713	136,189	137,707
ON	53,702	69,555	58,876	58,744
その他	49,948	73,158	77,313	78,963
有コール残	16,321	17,270	18,473	18,486

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。

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	▲0.012	▲0.084
T/N	-	-	▲0.010	▲0.084
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.002	▲0.084
2W	▲0.001	0.000	▲0.001	▲0.086
3W	-	-	-	▲0.093
1M	-	-	-	▲0.098
2M	-	-	0.015	-
3M	-	-	-	▲0.109
6M	-	-	-	▲0.121
1Y	-	-	-	▲0.131

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

10月7日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:00	日銀支店長会議 (テレビ会議)	-	21:30 (米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
14:00	地域経済報告 (さくらレポート、日銀)	-	-	-
14:00	8月 景気動向指数 速報 (内閣府)	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

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▲0.015%~▲0.003%の水準で出合が見られた。地銀業態に加え、都銀・信託業態の調達ニーズも強く、昨日と比べさらに堅調な地合となったため、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.003%の▲0.012%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.015 ~ ▲0.013	▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.015 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達ニーズが引き続き強く、堅調な地合で推移すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月6日	10月7日	10月7日	10月8日	10月8日	10月8日
券	+200	▲300	▲300	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲26,300	+3,200	+3,200	▲1,000	▲1,000	▲1,000
過不足	▲26,100	+2,900	+2,900	▲2,000	▲2,000	▲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
国庫短期証券買入		+1,000				
CP等買入			▲200			
国債補完供給		▲200	+200			
当座預金増減	▲25,300	+2,900	+2,900	▲2,000	▲2,000	▲2,000
当座預金残高	5,343,100	5,346,000	5,346,000	5,344,000	5,344,000	5,344,000
準備預金残高	4,740,100	主な需給要因				
積み終了先	4,740,000					
超過準備	4,740,000					
非準備先残高	603,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	70.0%					
乖離率	29.9%					

10月6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	按分
社債等買入(10/11~)	1,250	2,279	1,250	▲0.052	▲0.045	24.6
国債補完供給(10/6~10/7)	192	192	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)	所要 (億円)
10月5日時点 6,585,500	今積期の所要準備額 3,615,500
	10月7日以降の残り所要
	積数 100
	平均 0

国庫短期証券入札予定

10月7日	6ヶ月(第1028回)
10月8日	3ヶ月(第1029回)
10月15日	3ヶ月
10月19日	1年

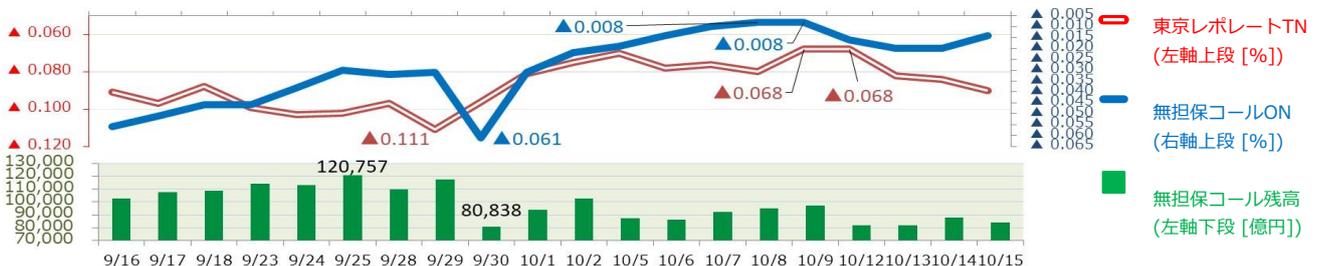
今月の国債買入オペ予定

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	1500	1,500	月1回	9月8日	1
1年超3年以下	4500	4,500	4 8 13 20	10月4日	3
3年超5年以下	4500	4,500	4 8 20 26	10月4日	3
5年超10年以下	4250	4,250	8 13 20 26	9月29日	4
10年超25年以下	1500	1,500	4	10月4日	0
25年超	500	500	20	9月24日	1
物価連動債	600	600	月1回	9月29日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	7月7日	-

1年前の市場推移

○2020年9月積み期 [9月16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(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会