



短期市場の推移

	10月5日	10月6日	10月7日	10月8日
加重平均金利	▲0.015	▲0.012	▲0.009	▲0.008
東京レポレート(TN)	▲0.085	▲0.084	▲0.082	▲0.080
無コール残	137,707	139,087	145,385	139,036
ON	58,744	60,274	66,022	62,723
その他	78,963	78,813	79,363	76,313
有コール残	18,486	18,057	18,002	18,000

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12日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	9月国内企業物価指数[前年比]	+5.9%	-	-
	-	-	-	-
	-	-	-	-

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	▲0.087	0.001	▲0.021	▲0.082
T/N	-	-	-	▲0.083
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.003	▲0.001	▲0.002	▲0.085
2W	▲0.003	▲0.001	▲0.002	▲0.087
3W	-	-	-	▲0.092
1M	-	-	▲0.001	▲0.098
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.108
6M	-	-	-	▲0.120
1Y	-	-	-	▲0.130

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.015%の出会いから始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.003%の水準で出会いが見られた。積み期終盤に向けて一部調達意欲が減退する先が見られ、出会い水準は低下した。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.013%の▲0.021%となった。また、日本銀行は10月積み期におけるマクロ加算残高の算出に用いる基準比率を13.0%に定めることとした。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.045	- ~ -	▲0.025 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達ニーズは引き続き弱く、出会い水準は本日対比若干の低下を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月11日	10月12日	10月12日	10月13日	10月13日	10月13日
券		+500	+200	+0	+0	+0
財政		▲28,200	+6,600	▲5,000	▲5,000	▲5,000
過不足		▲27,700	+6,800	▲5,000	▲5,000	▲5,000
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
国債買入		+14,800				
共通担保(全店)	▲200		▲100		▲4,000	
CP等買入		+1,300				
社債等買入		▲100	+100			
国債補充供給	+400					
当座預金増減		▲11,500	+6,800	▲9,000	▲9,000	▲9,000
当座預金残高		5,342,400	5,349,200	5,340,200	5,340,200	5,340,200
準備預金残高		4,756,200				
積み終了先		4,756,200				
超過準備		4,756,200				
非準備預金先残高		586,200				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		86.7%				
乖離率		13.3%				

10月11日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(10/11~10/12)	63	63	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリベース (億円)
10月8日時点 6,570,800

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,615,700
10月12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15日	3ヶ月(第1030回)
10月19日	1年
10月21日	6ヶ月
10月22日	3ヶ月
10月12日	30年
10月14日	5年
10月19日	20年
10月27日	2年

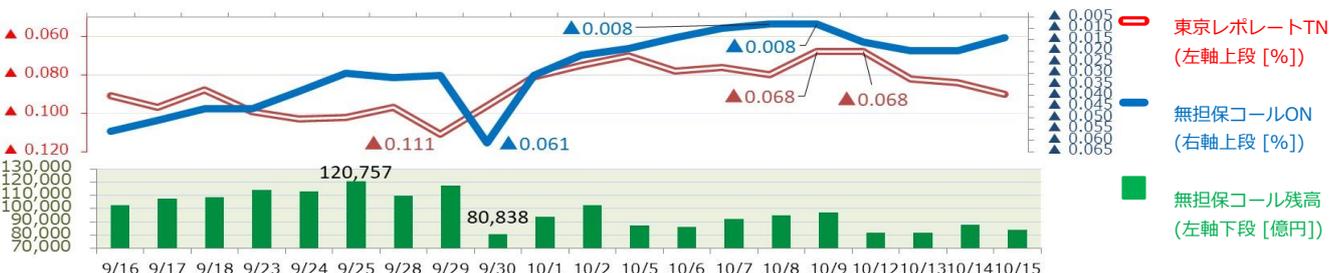
今月の国債買入オペ予定

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	10月8日	0
1年超3年以下	4500	4,500	4 8 13 20	10月8日	2
3年超5年以下	4500	4,500	4 8 20 26	10月8日	2
5年超10年以下	4250	4,250	8 13 20 26	10月8日	3
10年超25年以下	1500	1,500	4 20	10月4日	0
25年超	500	500		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

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