



デイリーシグナル

2021年10月18日(月)

短期市場の推移

	10月12日	10月13日	10月14日	10月15日
加重平均金利	▲0.032	▲0.040	▲0.052	▲0.046
東京レポレート(TN)	▲0.092	▲0.124	▲0.135	▲0.096
無コール残	138,007	143,526	152,472	140,288
ON	61,214	67,053	74,199	72,665
その他	76,793	76,473	78,273	67,623
有コール残	17,612	17,193	19,121	19,853

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	▲0.078	0.001	▲0.039	▲0.093
T/N	-	-	▲0.045	▲0.097
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.015	▲0.001	▲0.008	▲0.099
2W	▲0.060	▲0.003	▲0.035	▲0.102
3W	-	-	-	▲0.103
1M	▲0.020	0.001	▲0.004	▲0.105
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.015	▲0.114
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19日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 (米)9月住宅着工件数	161.5万戸
-	-	(米)サンフランシスコ連銀 総裁 講演	-
-	-	(米)アトランタ連銀 総裁 講演	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.040%の出合から始まり、その後は主に▲0.070%~▲0.010%の水準で出合が見られた。地銀業態を中心に調達に積極的な先も見られ、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.007%の▲0.039%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.070	▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.075 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

新積み期に入り、ビッドサイドの調達意欲は強く、出合水準は本日対比若干の上昇を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	10月18日	10月19日	10月18日	10月19日	10月20日
券	+100		▲100		+0
財政	▲2,000		+5,400		▲38,000
過不足	▲1,900		+5,300		▲38,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲400	+5,000	▲300		
国債補充供給	+100				
当座預金増減	+2,800		+5,000		▲38,000
当座預金残高	5,418,500		5,423,500		5,385,500
準備預金残高	4,774,300				
積み終了先	4,772,700				
超過準備	4,765,400				
非準備先残高	644,200				
準備預金進捗率	99.8%				
平均	9.7%				
乖離率	90.1%				

10月18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(10/18~10/19)	16	16	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
10月15日時点 6,632,500

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,735,100
10月19日以降の残り所要	
積数	6,900
平均	200

国債短期証券入札予定

10月19日	1年(第1031回)
10月21日	6ヶ月(第1032回)
10月22日	3ヶ月(第1033回)
10月29日	3ヶ月

国債入札予定

10月19日	20年
10月27日	2年
11月1日	10年
11月4日	物価連動

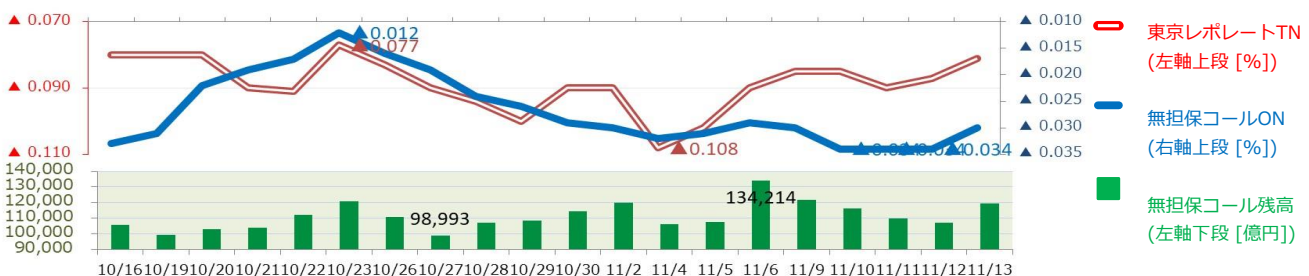
今月の国債買入オペ予定

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	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13日	1
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13日	2
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	10月13日	0

1年前の市場推移

○2020年10月積み期 [10月16日~11月13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