



デイリーシグナル

2021年10月21日(木)

短期市場の推移

	10月15日	10月18日	10月19日	10月20日
加重平均金利	▲0.046	▲0.039	▲0.038	▲0.036
東京レポレート(TN)	▲0.096	▲0.097	▲0.097	▲0.101
無コール残	140,288	159,214	165,509	171,660
ON	72,665	85,531	88,991	92,332
その他	67,623	73,683	76,518	79,328
有コール残	19,853	17,672	17,502	17,203

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	▲0.070	0.010	▲0.031	▲0.096
T/N	-	-	▲0.035	▲0.101
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.002	▲0.103
2W	-	-	-	▲0.104
3W	-	-	-	▲0.105
1M	-	-	▲0.020	▲0.108
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.115
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22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Q比指数 [前年比]	+0.1%	22:45	(米)10月製造業購買担当者指数 (PMI)	60.5
	-	-	22:45	(米)10月サービス業購買担当者指数 (PMI)	55.1
	-	-		(米)サンフランシスコ連銀総裁の講演	

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▲0.015%の出合から始まり、その後は主に▲0.055%~▲0.010%の水準で出合が見られた。引き続き様々な業態で調達ニーズは強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.005%の▲0.031%となった。なお、10月20日の無担保コール市場残高は、17兆1,660億円と2008年6月以来の17兆円台を記録した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.045 ~ ▲0.040	▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.055 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

引き続き都銀・地銀業態を中心に調達ニーズは強く、出合水準は本日対比で若干の上昇と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月21日	10月22日	10月22日	10月25日	10月25日	10月25日
券	▲1,200	▲800	▲800	▲800	▲800	+0
財政	▲2,200	+7,600	+7,600	▲3,000	▲3,000	▲3,000
過不足	▲3,400	+6,800	+6,800	▲3,000	▲3,000	▲3,000
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		+13,800				
CP等買入	▲300		▲100			
社債等買入			▲200			+800
E T F 買入		+500				
国債補充供給		▲500	+500			
当座預金増減	+10,100	+7,000	+7,000	▲2,200	▲2,200	▲2,200
当座預金残高	5,396,300	5,403,300	5,403,300	5,401,100	5,401,100	5,401,100
準備預金残高	4,749,400					
積み終了先	4,748,800					
超過準備	4,748,800					
非準備先残高	646,900					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	19.4%					
乖離率	80.5%					

10月21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(10/21~10/22)	251	251	▲0.350	▲0.350		
	226	226	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)
 10月20日時点 6,604,200

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,735,100
10月22日以降の残り所要	
積数	4,600
平均	200

国庫短期証券入札予定

10月22日	3ヶ月(第1033回)
10月29日	3ヶ月
9月3日	3ヶ月
9月9日	6ヶ月
10月27日	2年
9月2日	10年
9月7日	30年
9月9日	5年

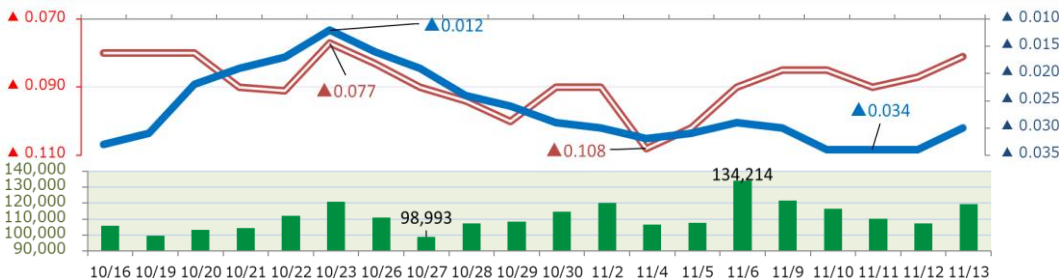
今月の国債買入オペ予定

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



東京レポレートTN (左軸上段 [%])

無担保コールON (右軸上段 [%])

無担保コール残高 (左軸下段 [億円])

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