

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年9月7日(月)

短期市場の推移

	9月1日	9月2日	9月3日	9月4日
加重平均金利	▲0.052	▲0.051	▲0.058	▲0.057
東京レポレート(ON)	▲0.089	▲0.086	▲0.111	▲0.106
無コール残	91,382	96,601	105,955	94,013
ON	60,209	63,828	70,987	57,245
その他	31,173	32,773	34,968	36,768
有コール残	21,037	21,794	20,767	19,748

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。

9月8日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想	
8:50	4-6月期国内総生産 (GDP)改定値 [前期比年率]	▲28.5%	18:00	(欧)4-6月期域内総生産 (GDP)確報値[前年比]	-15.0%
8:50	7月国際収支(財務省)	1兆8,720億円			

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	▲0.064	▲0.127
T/N	▲0.070	▲0.001	▲0.024	▲0.161
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	0.000	▲0.037	▲0.144
2W	▲0.050	0.180	▲0.029	▲0.128
3W	0.001	0.025	0.010	▲0.125
1M	-	-	-	▲0.124
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.124
6M	-	-	-	▲0.142
1Y	-	-	-	▲0.165

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▲0.055%の出合から始まり、その後は主に▲0.080%~▲0.055%の水準で出合が見られた。オファーサイドの放出ニーズが強い一方で、ビッドサイドの調達意欲は限定的であったため、地合は弱含み、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.007%の▲0.064%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	-	▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.080 ~ ▲0.045

翌営業日のマーケット

本日と同様の軟調な地合を予想。

資金需給

	日銀速報 9月7日	日銀予想 9月8日	当社需給予想 9月9日
券	+800	+900	+0
財政	▲7,700	+1,900	▲22,000
過不足	▲6,900	+2,800	▲22,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+5,300	+8,100
共通担保(全店)	▲2,800	+1,800	
CP等買入	▲200	+6,000	
国債補完供給	+100	▲100	+100
当座預金増減	+3,200	+11,000	▲22,000
当座預金残高	4,594,400	4,605,400	4,583,400
準備預金残高	3,951,200	主な需給要因	
積み終了先	3,951,200		
超過準備	3,951,200		
非準備先残高	643,200	国債発行(5年)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	74.2%		
乖離率	25.7%		

9月7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	接分
国債買入(9/8~)						
1~3年	4,200	7,433	4,207	0.000	0.002	56.8
3~5年	3,500	10,237	3,503	0.002	0.004	58.0
25年~	300	1,117	303	0.018	0.018	80.9
国債補完供給(9/7~9/8)						
		96	96	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
9月4日時点 5,776,700	今積期の所要準備額 3,516,000
	9月8日以降の残り所要積数 300
	平均 0

国庫短期証券入札予定

9月9日	6ヶ月	第935回
9月11日	3ヶ月	第936回
9月16日	1年	
9月18日	3ヶ月	
9月8日	5年	
9月10日	20年	
9月24日	40年	
9月29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	500~1,500	1,000	月3回程度	9月4日	2
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	2 7 11 16 23 28	9月7日	4
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	2 7 11 16 23 30	9月7日	4
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	4 11 16 23 28	9月4日	4
10年超25年以下	500~2,000	1,200	2 14	9月2日	1
25年超	0~500	300	7 28	9月7日	1
物価連動債	300	300	月2回程度	8月28日	2
変動利付債<偶数月>	1,000	1,000	月1回	8月5日	-

1年前の市場推移 ○2019年8月積み期 [8月16日~9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(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会