

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年9月1日(火)

短期市場の推移

	8月26日	8月27日	8月28日	8月31日
加重平均金利	▲0.051	▲0.054	▲0.054	▲0.057
東京レポレート(ON)	▲0.076	▲0.077	▲0.080	▲0.084
無コール残	92,953	92,894	91,731	91,177
ON	59,475	58,761	57,798	59,004
その他	33,478	34,133	33,933	32,173
有コール残	18,589	19,141	19,032	21,739

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。無コール残は無担保・有担保コール残高の意。

9月2日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マナターベース(8月)	-	18:00 (欧)7月生産者物価指数 [前年比]	-
10:00	営業毎旬報告(8月31日 現在)	-	21:15 (米)8月ADP全米雇用報 告	90.0万人

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	▲0.052	▲0.089
T/N	-	-	▲0.001	▲0.094
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	▲0.025	▲0.028	▲0.088
2W	▲0.035	0.000	▲0.019	▲0.088
3W	-	-	-	▲0.088
1M	-	-	-	▲0.092
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.097
6M	-	-	-	▲0.137
1Y	-	-	-	▲0.164

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▲0.050%の出合から始まり、その後は▲0.080%~▲0.030%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.005%の▲0.052%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.080	▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.060 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

引き続き地銀中心の出合となり、出合水準は概ね横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月1日	9月2日	9月2日	9月3日	9月3日	9月3日
券	+600	▲100	▲100	+0	+0	+0
財政	▲32,700	▲43,700	▲43,700	+1,000	+1,000	+1,000
過不足	▲32,100	▲43,800	▲43,800	+1,000	+1,000	+1,000
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			+20,000			
国債買入		+8,800				
CP等買入	▲100		▲200			
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+200	▲100	+100			
成長基盤強化支援資金供給			▲3,000	+1,800		
当座預金増減	▲23,300	▲25,200	▲25,200	+1,000	+1,000	+1,000
当座預金残高	4,618,900	4,593,700	4,593,700	4,594,700	4,594,700	4,594,700
準備預金残高	4,021,900					
積み終了先	4,021,800					
超過準備	4,021,800					
非準備先残高	597,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	54.8%					
乖離率	45.1%					

9月1日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国庫短期証券買入(9/2~)	20,000	59,059	20,001	0.004	0.007	65.4
米ドル資金供給(9/3~9/11)		10	10	0.340	0.340	
米ドル資金供給(9/3~11/27)		355	355	0.330	0.330	
国債補完供給(9/1~9/2)	76	76	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナターベース(億円)	所要
8月31日時点 5,828,600	今積期の所要準備額 3,499,200
	9月2日以降の残り所要積数 600
	平均 0

国庫短期証券入札予定

9月4日	3ヶ月	第934回
9月9日	6ヶ月	
9月11日	3ヶ月	
9月16日	1年	
9月3日	30年	
9月8日	5年	
9月10日	20年	
9月24日	40年	

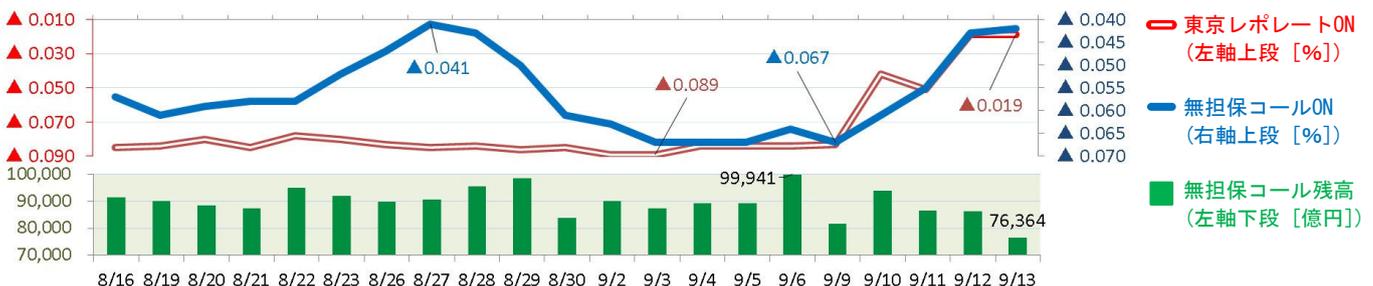
今月の国債買入オペ予定

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	8月31日	3
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	2 7 11 16 23 28	8月31日	6
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	2 7 11 16 23 30	8月31日	6
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	4 11 16 23 28	8月26日	5
10年超25年以下	500~2,000	1,200	2 14	8月28日	2
25年超	0~500	300	7 28	8月28日	2
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。