

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年9月4日(金)

短期市場の推移

	8月31日	9月1日	9月2日	9月3日
加重平均金利	▲0.057	▲0.052	▲0.051	▲0.058
東京レポレート(ON)	▲0.084	▲0.089	▲0.086	▲0.111
無コール残	91,177	91,382	96,601	105,955
ON	59,004	60,209	63,828	70,987
その他	32,173	31,173	32,773	34,968
有コール残	21,739	21,037	21,794	20,767

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7日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
14:00頃	消費活動指数	-	-	-
	-	-	-	-
	-	-	-	-

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	▲0.057	▲0.106
T/N	▲0.060	▲0.001	▲0.013	▲0.116
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	▲0.010	▲0.034	▲0.103
2W	-	-	▲0.045	▲0.102
3W	-	-	-	▲0.103
1M	-	-	-	▲0.105
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.109
6M	-	-	-	▲0.136
1Y	-	-	-	▲0.162

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▲0.087%~▲0.030%の水準で出合が見られた。資金調達を控える先が出てきたため、オファーが出し残る展開となり▲0.080%台の取引が減少した。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.057%となった。

	都銀・信託	証券	地銀
	- ~ -	▲ 0.070 ~ ▲ 0.055	▲ 0.085 ~ ▲ 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4日		9月7日		9月8日
券		+400		+900	+1,000
財政		▲4,500		▲500	+1,000
過不足		▲4,100		+400	+2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入				+5,300	
共通担保(全店)			▲2,800	+1,800	
CP等買入	▲600		▲200	+6,000	
社債等買入	▲100				
国債補完供給	+200	▲100	+100		
米ドル資金供給用担保国債供給	+1,000				
当座預金増減		▲3,700		+10,600	+2,000
当座預金残高		4,591,200		4,601,800	4,603,800
準備預金残高		3,960,900			
積み終了先		3,960,900			
超過準備		3,960,900			
非準備預金残高		630,300			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		71.0%			
乖離率		28.9%			

9月4日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(9/7~)						
~1年	1,000	2,320	1,002	0.010	0.010	95.7
5~10年	4,200	7,238	4,209	0.001	0.002	93.8
国債補完供給(9/4~9/7)						
共通担保(全店)			50	50	▲0.350	▲0.350
CP等買入			0	0		
共通担保(全店)(9/7~9/23)			20,000	1,801		

マナタリーベース	所要
9月3日時点 5,780,800	今積期の所要準備額 3,499,200
	9月7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2日	5
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	2 7 11 16 23 30	9月2日	5
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	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。