

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年9月8日(火)

短期市場の推移

	9月2日	9月3日	9月4日	9月7日
加重平均金利	▲0.051	▲0.058	▲0.057	▲0.064
東京レポレート(ON)	▲0.086	▲0.111	▲0.106	▲0.127
無コール残	96,601	105,955	94,013	85,037
ON	63,828	70,987	57,245	47,419
その他	32,773	34,968	36,768	37,618
有コール残	21,794	20,767	19,748	17,450

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9日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 マネーストック(8月)	-	23:00 (米)7月JOLT求人件数	600.0万件
-	-	(米)週間MBA住宅ローン申請指数	-
-	-	-	-

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	▲0.066	▲0.167
T/N	▲0.064	▲0.001	▲0.014	▲0.161
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	▲0.035	▲0.058	▲0.147
2W	▲0.065	0.010	▲0.033	▲0.134
3W	-	-	-	▲0.128
1M	-	-	-	▲0.130
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.127
6M	-	-	-	▲0.146
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▲0.070%の出合から始まり、その後は主に▲0.080%~▲0.060%の水増し出合が見られた。ビッドサイドの調達姿勢は引き続き限定的であり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.066%となった。

都銀・信託	証券	地銀
-	-	▲0.080 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

本日と同様に軟調な地合を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月8日	9月9日	9月9日	9月10日	9月10日	9月10日
券		+900		+800		+0
財政		+3,900		▲22,300		▲8,000
過不足		+4,800		▲21,500		▲8,000
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				+10,000		
国債買入		+8,100		▲100		
CP等買入				+200		
国債補完供給	+100	▲200				
当座預金増減		+12,800		▲11,400		▲8,000
当座預金残高		4,607,200		4,595,800		4,587,800
準備預金残高		3,958,400	主な需給要因			
積み終了先		3,958,400				
超過準備		3,958,400				
非準備先残高		648,800				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		77.4%				
乖離率		22.5%				
			国債発行(5年)		国庫短期証券発行・償還(6M)	

9月8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
国庫短期証券買入(9/9~)	10,000	30,650	10,003	0.004	0.006	62.9
国債補完供給(9/8~9/9)						
		186	186	▲0.350	▲0.350	
		50	50	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
9月7日時点 5,779,100	今積期の所要準備額 3,516,000
	9月9日以降の残り所要積数 200
	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	
国債入札予定		
9月10日	20年	
9月24日	40年	
9月29日	2年	
10月1日	10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