

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年9月10日(木)

短期市場の推移

	9月4日	9月7日	9月8日	9月9日
加重平均金利	▲0.057	▲0.064	▲0.066	▲0.070
東京レポレート(ON)	▲0.106	▲0.127	▲0.167	▲0.104
無コール残	94,013	85,037	94,118	86,748
ON	57,245	47,419	54,160	47,350
その他	36,768	37,618	39,958	39,398
有コール残	19,748	17,450	17,855	21,609

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11日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	8月国内企業物価指数 [前年比]	▲0.5%	21:30	(米)8月消費者物価コア 指数[前年比]	1.6%
	-			(米)8月財政収支	
	-			-	

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	▲0.073	▲0.094
T/N	▲0.010	▲0.001	▲0.001	▲0.095
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	▲0.020	▲0.055	▲0.099
2W	-	-	0.010	▲0.105
3W	-	-	-	▲0.116
1M	-	-	-	▲0.116
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.121
6M	-	-	-	▲0.145
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協会公表

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.075%の出合から始まり、その後は主に▲0.087%~▲0.050%の水準で出合が見られた。
昨日に引き続きビッドサイドの調達に限定的だったため、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.003%の▲0.073%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.087	▲0.087 ~ ▲0.087	▲0.087 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

3日積みではあるが、ビッドサイドの調達姿勢に大きな変化はないと思われるため、地合は本日と横這いを予想。

資金需給

	日銀速報 9月10日	日銀予想 9月11日	当社需給予想 9月14日
券	+200	+500	+0
財政	▲8,100	▲9,500	▲32,000
過不足	▲7,900	▲9,000	▲32,000
金融調節	エンド	エンド	エンド
CP等買入	▲800	▲1,200	
社債等買入		▲100	+3,000
国債補完供給	+200	+100	
当座預金増減	▲8,600	▲7,200	▲32,000
当座預金残高	4,588,300	4,581,100	4,549,100
準備預金残高	3,955,000	主な需給要因	
積み終了先	3,954,900	国債発行(20年)	国庫短期証券発行・償還(3M)
超過準備	3,954,900		源泉税揚げ
非準備先残高	633,300		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	83.9%		
乖離率	16.0%		

9月10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
国債補完供給(9/10~9/11)	97	97	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
9月9日時点 5,780,000

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,516,000
9月11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11日	3ヶ月	第936回
9月16日	1年	第937回
9月18日	3ヶ月	
9月24日	6ヶ月	
9月24日	40年	
9月29日	2年	
10月1日	10年	
10月6日	30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
物価運動債	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。