

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年9月16日(水)

短期市場の推移

	9月10日	9月11日	9月14日	9月15日
加重平均金利	▲0.073	▲0.074	▲0.072	▲0.052
東京レポレート(ON)	▲0.094	▲0.102	▲0.088	▲0.081
無コール残	87,786	90,678	102,893	100,059
ON	49,368	52,130	64,845	63,061
その他	38,418	38,548	38,048	36,998
有コール残	25,091	21,461	21,707	19,614

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17日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
9月日銀金融政策決定 会合(日銀当座預金)	▲0.1%	3:00	(米)9月連邦公開市場 委員会(FOMC)政策金利 0.25%
-	-	21:30	(米)新規失業保険申請件 数[前週分]
-	-	21:30	(米)8月住宅着工件数 146.3万戸

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	▲0.056	▲0.083
T/N	-	-	▲0.001	▲0.091
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.040	▲0.095
2W	▲0.050	▲0.015	▲0.033	▲0.104
3W	-	-	-	▲0.108
1M	-	-	-	▲0.113
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.119
6M	-	-	-	▲0.144
1Y	-	-	-	▲0.163

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▲0.075%~▲0.025%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▲0.004%の▲0.056%となった。
本日16日の当座預金残高は貸出増加支援資金供給オペ等を要因に過去最高の467兆2,000億円となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.075	▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.075 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

引き続き地銀中心の出合となり、出合水準は上昇を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月16日	9月17日	9月17日	9月18日	9月18日	9月19日
券	▲200	▲1,700	▲1,700	▲1,000	▲1,000	▲1,000
財政	▲4,300	+600	+600	+1,000	+1,000	+1,000
過不足	▲4,500	▲1,100	▲1,100	+0	+0	+0
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		+15,000				
国債買入				+12,100		
CP等買入	▲400	▲700	▲700	+6,000		
国債補完供給	+100	▲300	+300			
被災地支援資金供給					▲800	+800
米ドル用担保供給						+15,100
貸出増加支援資金供給	▲44,300	+132,300				
当座預金増減		+97,900		+16,600		+15,100
当座預金残高		4,672,000		4,688,600		4,703,700
準備預金残高		4,065,900				
積み終了先		2,630,200				
超過準備		1,164,600				
非準備先残高		606,100				
準備預金進捗率		85.1%				
平均		3.3%				
乖離率		81.8%				

9月16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(9/17~)						
1~3年	4,200	15,846	4,202	▲0.002	0.000	12.0
3~5年	3,500	9,561	3,501	▲0.006	▲0.004	43.6
5~10年	4,200	9,310	4,209	▲0.004	▲0.001	42.3
国債補完供給(9/16~9/17)						
		308	308	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
9月15日時点 5,756,600	今積期の所要準備額 3,409,900
	9月17日以降の残り所要積数 508,500
	平均 17,500

国庫短期証券入札予定

9月18日	3ヶ月	第938回
9月24日	6ヶ月	
9月25日	3ヶ月	
10月2日	3ヶ月	
国債入札予定		
9月24日	40年	
9月29日	2年	
10月1日	10年	
10月6日	30年	

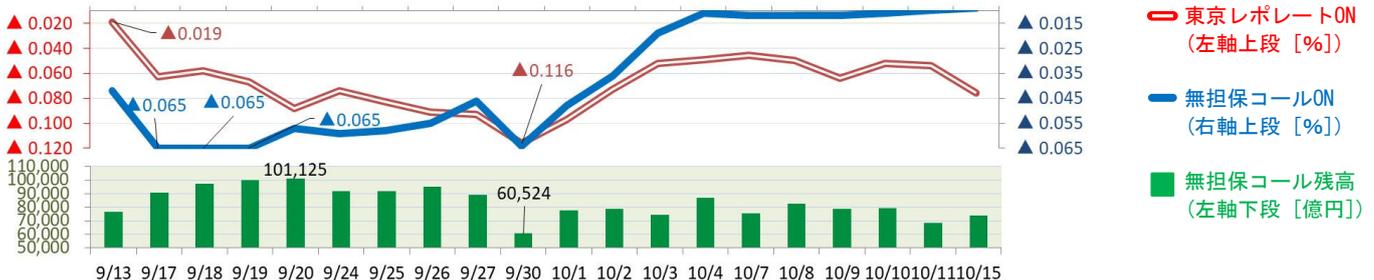
今月の国債買入オペ予定

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16日	2
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	2 7 11 16 23 30	9月16日	2
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	4 11 16 23 28	9月16日	2
10年超25年以下	500~2,000	1,200	2 14	9月14日	0
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	9月14日	1
変動利付債<偶数月>	1,000	1,000	月1回	8月5日	0

1年前の市場推移

○2019年9月積み期 [9月13日~10月15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。