

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年9月18日(金)

## 短期市場の推移

[億円] [%]

	9月14日	9月15日	9月16日	9月17日
加重平均金利	▲0.072	▲0.052	▲0.056	▲0.051
東京レポレート(ON)	▲0.088	▲0.081	▲0.083	▲0.089
無コール残	102,893	100,059	102,494	107,876
ON	64,845	63,061	64,596	69,378
その他	38,048	36,998	37,898	38,498
有コール残	21,707	19,614	19,936	20,050

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23日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
14:35 【挨拶】黒田総裁(大阪)	-	22:45 (米)9月製造業購買部担当者指数(PMI)	52.5
-	-	22:45 (米)9月サービス業購買部担当者指数(PMI)	54.5
-	-	-	-

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

## 本日の市況

	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	▲0.046	▲0.090
T/N	▲0.020	▲0.001	▲0.003	▲0.088
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.001	▲0.010	▲0.093
2W	-	-	-	▲0.103
3W	-	-	-	▲0.109
1M	-	-	-	▲0.113
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.118
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

本日の無担保コールON物は▲0.035%の出合から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.015%の水準で出合が見られた。地銀業態の調達ニーズは引き続き強く同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.005%の▲0.046%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.075	▲0.080 ~ ▲0.075	▲0.075 ~ ▲0.015

## 翌営業日のマーケット

引き続き地銀中心の出合となり、出合水準は横這いを予想。

## 資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	9月18日	9月23日	9月24日
券	▲1,500	+800	+1,000
財政	+10,900	+80,400	▲1,000
過不足	+9,400	+81,200	+0
金融調節	エンド	エンド	スタート
共通担保(全店)	▲800	▲1,800	▲3,800
CP等買入	▲700	▲900	-
社債等買入	▲800	-	-
被災地金融機関支援資金供給	+800	-	-
国債補完供給	+700	+300	-
米ドル資金供給用担保国債供給	+15,500	-	-
当座預金増減	+23,800	+82,600	+0
当座預金残高	4,713,000	4,795,600	4,795,600
準備預金残高	4,069,700	4,068,400	4,068,400
積み終了先	4,068,400	4,068,400	4,068,400
超過準備	4,060,700	4,060,700	4,060,700
非準備先残高	643,300	643,300	643,300
準備預金進捗率	99.8%	99.8%	99.8%
平均	23.3%	23.3%	23.3%
乖離率	76.5%	76.5%	76.5%

## 9月18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(9/18~9/23)	288	288	▲0.350	▲0.350	-	-
共通担保(全店)(9/23~10/5)	20,000	3,801	3,801	-	-	-

マナタリーベース [億円]  
9月17日時点 5,873,600

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,409,900  
9月23日以降の残り所要積数 7,300  
平均 300

## 国庫短期証券入札予定

## 今月の国債買入オペ予定

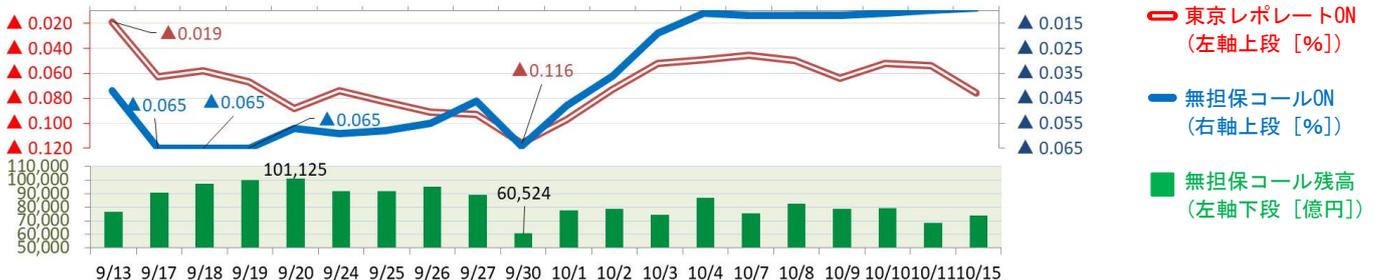
9月24日	6ヶ月	第939回
9月25日	3ヶ月	第940回
10月2日	3ヶ月	
10月8日	6ヶ月	
9月24日	40年	
9月29日	2年	
10月1日	10年	
10月6日	30年	

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。

上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会