

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年9月23日(水)

短期市場の推移

	9月15日	9月16日	9月17日	9月18日
加重平均金利	▲0.052	▲0.056	▲0.051	▲0.046
東京レポレート(ON)	▲0.081	▲0.083	▲0.089	▲0.090
無コール残	100,059	102,494	107,876	108,873
ON	63,061	64,596	69,378	68,580
その他	36,998	37,898	38,498	40,293
有コール残	19,614	19,936	20,050	21,069

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24日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	政策委員会・金融政策決定会合議事要旨(7月14・15日分)	-	21:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分]
10:00	営業毎旬報告(9月20日現在)	-	23:00	(米)8月新築住宅販売件数
14:00	基礎的なインフレ率を捕捉するための指標	-	-	88.0万戸

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	▲0.046	▲0.091
T/N	-	-	▲0.015	▲0.099
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	0.020	▲0.022	▲0.104
2W	-	-	0.170	▲0.104
3W	-	-	-	▲0.107
1M	-	-	-	▲0.111
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.118
6M	-	-	-	▲0.143
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▲0.030%の出合から始まり、その後は主に▲0.080%~▲0.015%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.046%となった。
本日23日の当座預金残高(速報)は国債償還等を要因に増加し、過去最高の478兆6,400億円となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.060	▲0.070 ~ ▲0.060	▲0.050 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲が強く、堅調な地合を想定。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	9月23日	9月24日	9月25日
券	+600	▲300	+0
財政	+71,500	+1,600	▲39,000
過不足	+72,100	+1,300	▲39,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+10,000
国債買入			+13,100
共通担保(全店)	▲1,800	+3,800	
CP等買入	▲900	▲500	
社債等買入			+2,000
国債補完供給	+300	▲100	+100
当座預金増減	+73,400	+24,000	▲37,000
当座預金残高	4,786,400	4,810,400	4,773,400
準備預金残高	4,144,900	主な需給要因	
積み終了先	4,143,500		
超過準備	4,143,500	国債発行(40年)	
非準備預金残高	641,500	国庫短期証券発行(6M)	
準備預金進捗率	99.8%		
平均	26.7%		
乖離率	73.2%		

9月23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(9/24~)	10,000	27,800	10,001	0.003	0.005	57.9
国債買入(9/24~)						
~1年	1,000	2,672	1,002	0.005	0.006	62.9
1~3年	4,200	12,222	4,203	▲0.008	▲0.006	17.6
3~5年	3,500	10,332	3,504	▲0.009	▲0.008	84.6
5~10年	4,200	9,971	4,212	▲0.007	▲0.006	86.7
米ドル資金供給(9/25~10/1)		670	670	0.340	0.340	
米ドル資金供給(9/25~12/17)		0	0	0.330	0.330	
社債等買入(9/25~)	2,000	3,451	2,000	0.133	0.154	3.5
国債補完供給(9/23~9/24)		109	109	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マナタリーベース [億円]
9月18日時点 5,898,800

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,409,900
9月24日以降の残り所要積数 5,900
平均 300

国庫短期証券入札予定

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	
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	

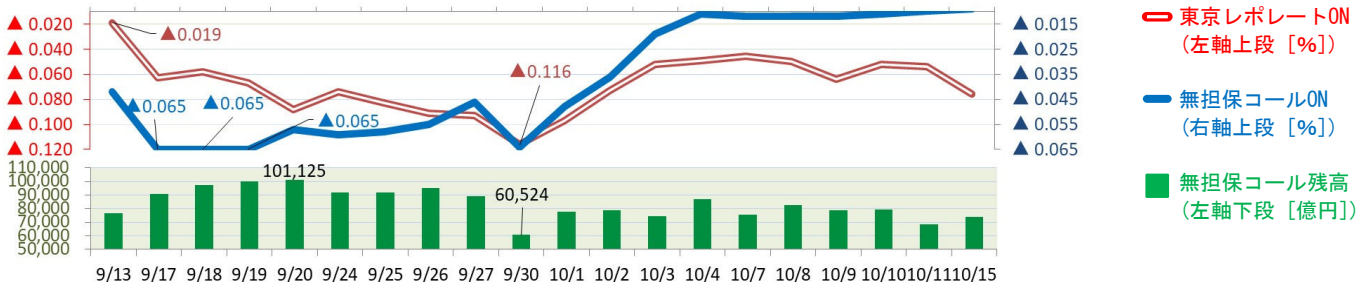
今月の国債買入オペ予定

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23日	1
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	2 7 11 16 23 28	9月23日	1
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	2 7 11 16 23 30	9月23日	1
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	4 11 16 23 28	9月23日	1
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	1

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。