

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年9月5日(木)

## 短期市場の推移

	8月30日	9月2日	9月3日	9月4日
加重平均金利	▲0.061	▲0.063	▲0.067	▲0.067
東京レポレート(ON)	▲0.085	▲0.089	▲0.089	▲0.084
無コール残	83,938	90,120	87,330	89,186
ON	53,393	58,380	55,780	55,836
その他	30,545	31,740	31,550	33,350
有コール残	21,043	19,892	22,780	25,691

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6日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
-	7月の毎月勤労統計速報	-	(米)8月の雇用統計	-
-	8月上中旬の貿易収支	-	-	-
-	7月の景気動向指数速報	-	-	-

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	▲0.080	0.001	▲0.067	▲0.084
T/N	-	-	▲0.045	▲0.090
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.035	▲0.045	▲0.091
2W	-	-	▲0.040	▲0.098
3W	-	-	-	▲0.104
1M	-	-	-	▲0.123
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.137
6M	-	-	-	▲0.160
1Y	-	-	-	▲0.171

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%の出合から始まった。その後は、主に▲0.075%~▲0.050%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日と横ばいの▲0.067%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.075	▲0.070 ~ ▲0.070	▲0.075 ~ ▲0.050

## 翌営業日のマーケット

週末3日積みということもあり、本日対比で出合水準は上昇すると予想。

## 資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	9月5日	9月6日	9月9日
券	▲100	+500	+1,000
財政	+3,200	▲10,000	▲2,000
過不足	+3,100	▲9,500	▲1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
共通担保(全店)			▲900
CP等買入	▲600	▲300	
ETF買入	+500		
国債補完供給	+400	▲400	+400
当座預金増減	+3,000	▲9,400	▲1,900
当座預金残高	3,968,900	3,959,500	3,957,600
準備預金残高	3,462,000	主な需給要因	
積み終了先	3,461,700	国債発行(30年)	
超過準備	3,461,700	国庫短期証券発行・償還(3M)	
非準備先残高	506,900		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	67.7%		
乖離率	32.2%		

## 9月5日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
CP等買入(9/10~)	4,000	6,368	3,993	▲0.006	▲0.003	31.1
国債補完供給(9/5~9/6)		350	350	▲0.350	▲0.350	

マナタリーベース [億円]  
9月4日時点 5,087,100

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,179,800  
9月6日以降の残り所要積数 1,800  
平均 200

## 国庫短期証券入札予定

9月6日	3ヶ月	第855回
9月9日	6ヶ月	第856回
9月13日	3ヶ月	
9月18日	1年	
9月11日	5年	
9月18日	20年	
9月25日	40年	
9月27日	2年	

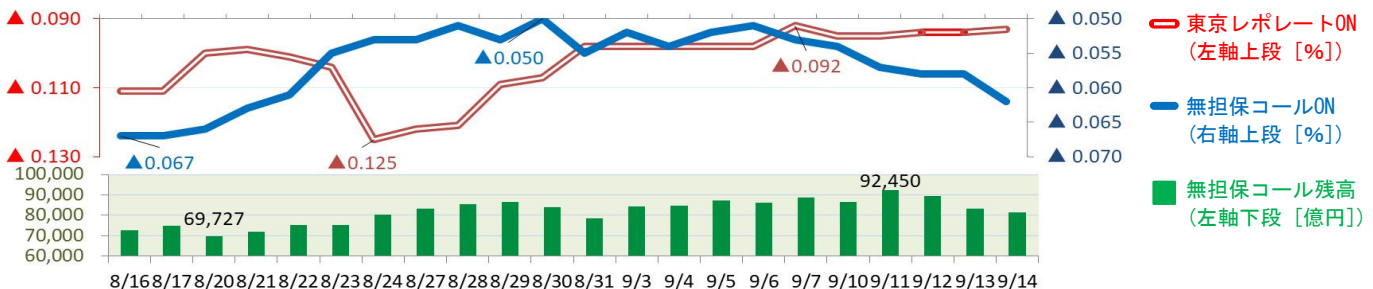
## 今月の国債買入オペ予定

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	100~1,000 程度	500	月2回程度	8月30日	2
1年超3年以下	2,500~5,000 程度	4,000		8月30日	4
3年超5年以下	2,500~5,000 程度	3,600	6 17 24 30	8月30日	4
5年超10年以下	2,500~5,500 程度	4,000	6 12 20 26	8月30日	4
10年超25年以下	1,000~2,500 程度	1,400		9月2日	2
25年超	100~1,000 程度	400	2 12 20		
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	8月26日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	月1回	8月5日	-

## 1年前の市場推移

○2018年8月積み期 [8月16日~9月14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。