

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年9月9日(月)

短期市場の推移

	9月3日	9月4日	9月5日	9月6日
加重平均金利	▲0.067	▲0.067	▲0.067	▲0.064
東京レポレート(ON)	▲0.089	▲0.084	▲0.084	▲0.084
無コール残	87,330	89,186	89,299	99,941
ON	55,780	55,836	55,089	66,296
その他	31,550	33,350	34,210	33,645
有コール残	22,780	25,691	25,836	25,453

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10日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50	マネーストック(8月)	10:30	(中)8月消費者物価指数 [前年比] 2.6%
-	-	17:30	(英)8月失業率 -
-	-	23:00	(米)7月JOLT求人件数 -

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	▲0.086	0.001	▲0.067	▲0.083
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.050	▲0.089
2W	-	-	-	▲0.096
3W	-	-	-	▲0.116
1M	-	-	-	▲0.123
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.137
6M	-	-	-	▲0.163
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、▲0.075%の出合から始まり、その後は▲0.085%~▲0.040%の水準で取引された。台風15号の影響により、通常と比較すると朝一の取引参加者は少なく、同加重平均金利(速報)は前営業日▲0.003%の▲0.067%となった。日本銀行は、9~11月積み期間のマクロ加算残高の算出に用いる基準比率について、37.0%と定めることとした。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.080	▲0.075 ~ ▲0.070	▲0.075 ~ ▲0.040

翌営業日のマーケット

市場参加者が増加する見込みのため、出合水準は上昇すると予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月9日	9月10日	9月10日	9月11日	9月11日	9月11日
券	+800	+700	+700	+0	+0	
財政	+2,800	▲10,800	▲10,800	+2,000	+2,000	
過不足	+3,600	▲10,100	▲10,100	+2,000	+2,000	
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
国債買入	+12,600					
共通担保(全店)	▲900	+500				
CP等買入	▲200		▲500	+4,000		
社債等買入	▲100					
ETF買入				+200		
国債補完供給	+100	▲200	+200			
当座預金増減	+15,400	▲6,200	▲6,200	+2,000	+2,000	
当座預金残高	3,977,100	3,970,900	3,970,900	3,972,900	3,972,900	
準備預金残高	3,484,600	主な需給要因				
積み終了先	3,484,400					
超過準備	3,484,400					
非準備預金残高	492,500	国庫短期証券 発行・償還(6M)				
準備預金進捗率	99.9%					
平均	80.6%					
乖離率	19.3%					

9月9日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債補完供給(9/9~9/10)	189	189	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [億円]
9月6日時点 5,082,400

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,182,200
9月10日以降の残り所要
積数 900
平均 100

国庫短期証券入札予定

9月13日	3ヶ月	第857回
9月18日	1年	
9月20日	3ヶ月	
9月27日	3ヶ月	
9月11日	5年	
9月18日	20年	
9月25日	40年	
9月27日	2年	

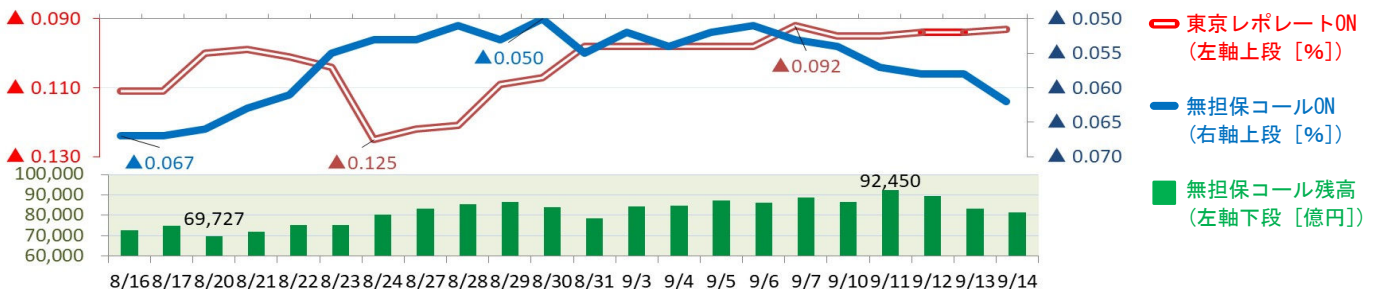
今月の国債買入オペ予定

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	9月6日	1
1年超3年以下	2,500~5,000 程度	4,000			
3年超5年以下	2,500~5,000 程度	3,600	6 17 24 30	9月6日	3
5年超10年以下	2,500~5,500 程度	4,000	6 12 20 26	9月6日	3
10年超25年以下	1,000~2,500 程度	1,400			
25年超	100~1,000 程度	400	2 12 20	9月2日	2
物価運動債	250 程度	250	月2回程度	9月6日	1
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。