

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年9月13日(金)

短期市場の推移 [億円] [%]

	9月9日	9月10日	9月11日	9月12日
加重平均金利	▲0.067	▲0.061	▲0.055	▲0.043
東京レポレート(ON)	▲0.083	▲0.042	▲0.051	▲0.019
無コール残	81,666	94,004	86,514	86,329
ON	49,061	61,399	54,709	54,604
その他	32,605	32,605	31,805	31,725
有コール残	21,971	23,113	22,179	20,016

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17日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
17:00	業態別の日銀当座預金残高(8月)	-	(米)FOMC(18日まで)	
	-		22:15 (米)8月鉱工業生産指数 [前月比]	0.2%
	-		-	

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	▲0.085	0.001	▲0.042	▲0.019
T/N	-	-	-	▲0.074
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.035	▲0.038	▲0.085
2W	-	-	-	▲0.104
3W	-	-	-	▲0.109
1M	-	-	0.025	▲0.114
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.134
6M	-	-	-	▲0.165
1Y	-	-	-	▲0.173

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、▲0.035%の出合から始まり、その後は▲0.055%~▲0.025%の水準で取引された。調達一巡後はビッドが薄くなり、▲0.08%台での出合も散見された。同加重平均金利(速報)は前営業日+0.001%の▲0.042%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.050		▲0.040 ~ ▲0.035	▲0.065 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

新積み期に入り資金調達ニーズが弱まる見込みのため、出合の水準は低下すると予想。

資金需給 [億円]

	日銀速報 9月13日	日銀予想 9月17日	当社需給予想 9月18日
券	▲100	+1,000	+0
財政	▲1,400	+6,100	▲1,000
過不足	▲1,500	+7,100	▲1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+6,100	スタート
共通担保(全店)		▲2,200	+2,200
CP等買入	▲400	▲700	+4,000
社債等買入	▲100		
国債補完供給	▲100	+100	
貸出増加支援		▲4,800	+13,000
当座預金増減	+4,000	+18,700	▲1,000
当座預金残高	3,959,900	3,978,600	3,977,600
準備預金残高	3,432,300	主な需給要因	
積み終了先	3,432,300	国債償還(2年)	
超過準備	3,432,300	国庫短期証券	
非準備預金残高	527,000	発行・償還(3M)	
準備預金進捗率	100.0%	個人向け国債	
平均	100.0%	発行・償還	
乖離率	0.0%		

9月13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(9/13~9/17)	113	113	▲0.250	▲0.250		
共通担保(全店)(9/17~9/30)	1	1	▲0.250	▲0.250		
	15,000	2,238	2,238			

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
9月12日時点 5,075,000	来積期の所要準備額 3,081,200
	9月17日以降の残り所要積数 587,400
	平均 20,300

国庫短期証券入札予定

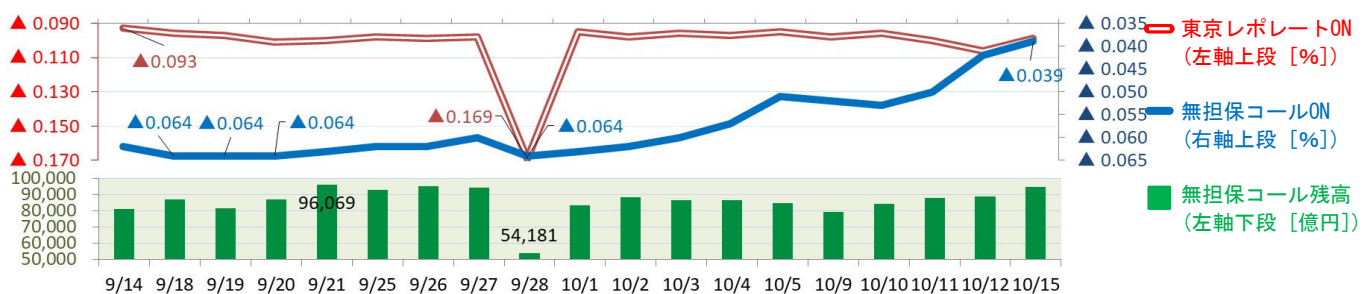
9月18日	1年	第858回
9月20日	3ヶ月	第859回
9月27日	3ヶ月	
10月4日	3ヶ月	
9月18日	20年	
9月25日	40年	
9月27日	2年	
10月1日	10年	

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12日	2
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12日	1
物価連動債	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9月積み期 [9月14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(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会