

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2019年9月18日(水)

短期市場の推移

[億円] [%]

	9月11日	9月12日	9月13日	9月17日
加重平均金利	▲0.055	▲0.043	▲0.042	▲0.065
東京レポレート(ON)	▲0.051	▲0.019	▲0.019	▲0.063
無コール残	86,514	86,329	76,364	90,655
ON	54,709	54,604	47,789	60,560
その他	31,805	31,725	28,575	30,095
有コール残	22,179	20,016	21,858	23,051

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19日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	預金種類別店頭表示金利の平均年率等	-	3:00	(米)9月連邦公開市場委員会(FOMC)政策金利	2.00%
-	9月日銀金融政策決定会合(日銀当座預金)	▲0.1%	21:30	(米)9月フィデラフィア連銀製造業景況指数	10.8
-	政策委員会・金融政策決定会合の決定内容	-	21:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分]	-

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	▲0.080	0.001	▲0.065	▲0.058
T/N	-	-	-	▲0.067
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.035	▲0.005	▲0.023	▲0.078
2W	-	-	▲0.020	▲0.104
3W	-	-	-	▲0.107
1M	-	-	-	▲0.111
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.129
6M	-	-	-	▲0.162
1Y	-	-	-	▲0.170

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、▲0.075%の合出から始まり、その後は▲0.08%~▲0.040%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.065%となった。

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

翌営業日のマーケット

調達サイドの動向に変化はなく、合出の水準は横ばいと予想する。

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19日	9月20日
券	+400	▲1,200	▲1,000
財政	+1,200	▲8,900	+127,000
過不足	+1,600	▲10,100	+126,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+7,700	-	-
CP等買入	▲200	▲400	-
ETF買入	+700	-	-
被災地金融機関支援	-	-	▲800
国債補完供給	+200	+300	+800
当座預金増減	+9,700	▲10,200	+126,000
当座預金残高	3,984,200	3,974,000	4,100,000
準備預金残高	3,483,500	主な需給要因	
積み終了先	3,437,700	国債償還(5年10年)	20年変動15年)
超過準備	3,424,700	国債発行(20年)	国庫短期証券発行・償還(1Y)
非準備先残高	500,700	-	-
準備預金進捗率	97.9%	-	-
平均	10.0%	-	-
乖離率	87.9%	-	-

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(9/18~9/19)	298	298	▲0.350	▲0.350		

マナタリーベース [億円]
9月17日時点 5,092,600

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,081,200
9月19日以降の残り所要積数 63,300
平均 2,300

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

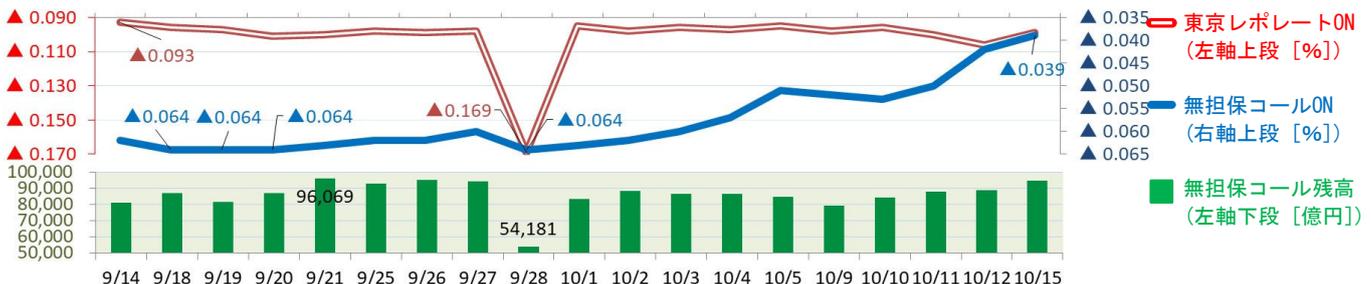
9月20日	3ヶ月	第859回
9月27日	3ヶ月	
10月4日	3ヶ月	
10月9日	6ヶ月	
9月25日	40年	
9月27日	2年	
10月1日	10年	
10月10日	30年	

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	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17日	2
5年超10年以下	2,500~5,000 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。