



デイリーシグナル

2021年9月14日(火)

短期市場の推移

	9月8日	9月9日	9月10日	9月13日
加重平均金利	▲0.009	▲0.006	▲0.010	▲0.016
東京レポレート(TN)	▲0.076	▲0.077	▲0.069	▲0.065
無コール残	117,462	137,054	134,844	126,279
ON	52,999	71,391	67,911	59,246
その他	64,463	65,663	66,933	67,033
有コール残	18,146	18,396	18,412	18,559

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。

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	▲0.070	0.001	▲0.024	▲0.063
T/N	-	-	▲0.008	▲0.065
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.001	▲0.083
2W	▲0.003	0.001	▲0.001	▲0.087
3W	-	-	-	▲0.094
1M	-	-	-	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.109
6M	-	-	-	▲0.120
1Y	-	-	-	▲0.130

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

9月15日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	7月コア機械受注[前月比]	+3.5%	18:00	(欧)7月鉱工業生産指数[前月比]	0.5%
	-	-		-	-
	-	-		-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.010%の合出から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.003%の水準で合出が見られた。大手行を中心に調達ニーズが限定的であり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.008%の▲0.024%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.055	- ~ -	▲0.045 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

積み最終日も、引き続きビッドサイドの調達ニーズは弱く、合出水準は本日対比でさらに低下を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月14日	9月15日	9月14日	9月15日	9月14日	9月15日
券	+800		▲200		▲2,000	
財政	+9,000		▲5,700		▲2,000	
過不足	+9,800		▲5,900		▲4,000	
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
国庫短期証券買入				+1,000		
共通担保(全店)			▲2,400	+2,900		
CP等買入			▲700	+5,000		
社債等買入			▲100			
国債補充供給	+700	▲200	+200			
貸出増加支援			▲32,600	+27,700		
当座預金増減	+10,300		▲4,900		▲4,000	
当座預金残高	5,292,300		5,287,400		5,283,400	
準備預金残高	4,689,800		主な需給要因			
積み終了先	4,689,800					
超過準備	4,689,800					
非準備先残高	602,500					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	96.8%					
乖離率	3.2%					

9月14日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(9/15~)	1,000	10,079	1,000	0.005	0.006	12.4
米ドル資金供給(9/16~9/24)	1	1	0.330	0.330		
国債補充供給(9/14~9/15)	189	189	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(9/15~9/29)	20,000	2,853	2,853			

マネタリーベース (億円)
9月13日時点 6,498,200

所要	今積期の所要準備額
9月15日以降の残り所要	3,736,800
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

9月16日	1年	第1023回
9月17日	3ヶ月	第1024回
9月21日	6ヶ月	第1025回
9月24日	3ヶ月	

国債入札予定

9月16日	20年
9月28日	40年
9月30日	2年
10月5日	10年

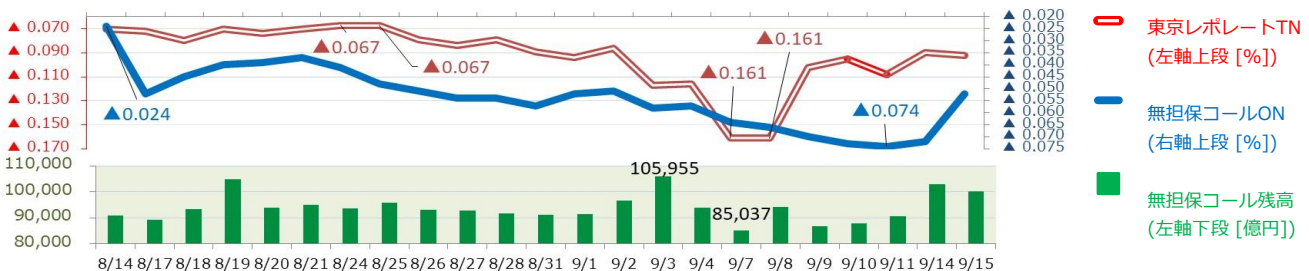
今月の国債買入オペ予定

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	1500	1,500	月1回	9月8日	0
1年超3年以下	4500	4,500	3 8 15 24	9月8日	2
3年超5年以下	4500	4,500	3 15 24 29	9月3日	3
5年超10年以下	4250	4,250	8 15 24 29	9月8日	3
10年超25年以下	1500	1,500	3	9月3日	0
25年超	500	500	24	8月25日	1
物価連動債	600	600	月1回	8月12日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	7月7日	-

1年前の市場推移

○2020年8月積み期 [8月14日~9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(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会