

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年9月28日(月)

短期市場の推移

	9月18日	9月23日	9月24日	9月25日
加重平均金利	▲0.046	▲0.046	▲0.038	▲0.030
東京レポレート(ON)	▲0.090	▲0.091	▲0.102	▲0.101
無コール残	108,873	113,951	112,935	120,757
ON	68,580	75,418	73,522	77,414
その他	40,293	38,533	39,413	43,343
有コール残	21,069	20,790	19,340	23,014

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29日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
金融政策決定会合における主な意見(9月16・17日分)		(米)9月消費者信頼感指数	
-		-	
-		-	

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	▲0.087	0.001	▲0.032	▲0.094
T/N	▲0.030	▲0.001	▲0.011	▲0.097
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.300	▲0.109
2W	-	-	-	▲0.108
3W	-	-	-	▲0.110
1M	-	-	-	▲0.113
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.124
6M	-	-	-	▲0.144
1Y	-	-	-	▲0.163

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▲0.025%の出合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.015%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.032%となった。なお、9月25日の無担保コール市場残高は2020年6月19日以来、約3か月ぶりの12兆円台となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.040	▲0.035 ~ ▲0.030	▲0.040 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達ニーズが強く、堅調な地合になると予想。

資金需給

	日銀速報 9月28日	日銀予想 9月29日	当社需給予想 9月30日
券	+500	+100	+100
財政	▲4,600	▲6,800	▲1,000
過不足	▲4,100	▲6,700	▲900
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		▲9,100	
CP等買入	▲1,000	▲900	+6,000
ETF買入			+400
国債補完供給	+900		
米ドル資金供給用担保国債供給	+1,600		
当座預金増減	▲2,600	+7,900	▲900
当座預金残高	4,871,800	4,879,700	4,878,800
準備預金残高	4,222,600	主な需給要因	
積み終了先	4,222,400		
超過準備	4,222,400		
非準預先残高	649,200		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	43.3%		
乖離率	56.6%		

9月28日のオペ結果

オペ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 接分

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(9/29~)						
1~3年	4,200	9,590	4,204	0.002	0.003	84.8
5~10年	4,200	15,373	4,202	0.004	0.004	77.1
25年~	300	1,363	304	0.014	0.015	63.2
物価連動	300	1,439	303	▲0.150	▲0.201	46.2
国債補完供給(9/28~9/29)						
		14	14	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マナタリーベース(億円)	所要
9月25日時点 6,060,400	今積期の所要準備額 3,409,900
	9月29日以降の残り所要積数 3,800
	平均 200

国庫短期証券入札予定

10月2日	3ヶ月	第941回
10月8日	6ヶ月	
10月9日	3ヶ月	
10月16日	3ヶ月	
9月29日	2年	
10月1日	10年	
10月6日	30年	
10月8日	5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	500~1,500	1,000	月3回程度	9月23日	1
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	2 7 11 16 23 28	9月28日	0
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	2 7 11 16 23 30	9月23日	1
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	4 11 16 23 28	9月28日	0
10年超25年以下	500~2,000	1,200	2 14	9月14日	0
25年超	0~500	300	7 28	9月28日	0
物価連動債	300	300	月2回程度	9月28日	0
変動利付債<偶数月>	1,000	1,000	月1回	8月5日	-

1年前の市場推移

○2019年9月積み期 [9月13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