

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年9月29日(火)

短期市場の推移

[億円][%]

	9月23日	9月24日	9月25日	9月28日
加重平均金利	▲0.046	▲0.038	▲0.030	▲0.032
東京レポレート(ON)	▲0.091	▲0.102	▲0.101	▲0.094
無コール残	113,951	112,935	120,757	109,736
ON	75,418	73,522	77,414	69,073
その他	38,533	39,413	43,343	40,663
有コール残	20,790	19,340	23,014	22,158

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30日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	8月鉱工業生産指数(前月比)	+1.1%	21:15	(米)9月ADP全米雇用報告	62.5万人
19:30頃	日銀当座預金増減要因と金融調節(9月実績速報)	-	21:30	(米)4-6月期国内総生産(GDP)確報値[前期比年率]	-31.6%

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	▲0.070	0.001	▲0.031	▲0.103
T/N	▲0.087	▲0.001	▲0.024	▲0.111
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.025	▲0.107
2W	-	-	-	▲0.107
3W	-	-	-	▲0.108
1M	-	-	-	▲0.113
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.124
6M	-	-	-	▲0.145
1Y	-	-	-	▲0.166

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▲0.025%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+0.001%の▲0.031%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

9月末で調達を控える先もあり、出合い水準は低下すると予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報 9月29日	日銀予想 9月30日	当社需給予想 10月1日
券	+100	▲300	+0
財政	▲6,600	▲1,200	▲25,000
過不足	▲6,500	▲1,500	▲25,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+10,000
国債買入	+9,100		
CP等買入	▲900	▲11,500	
ETF買入	+400		
国債補完供給	▲200	+200	
当座預金増減	+7,900	▲2,800	▲25,000
当座預金残高	4,879,700	4,876,900	4,851,900
準備預金残高	4,228,600	主な需給要因	
積み終了先	4,228,500		
超過準備	4,228,500		
非準預先残高	651,100	国債発行・償還(2年)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	46.7%		
乖離率	53.2%		

9月29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
国庫短期証券買入(9/30~)	10,000	38,796	10,002	0.006	0.009	35.2
米ドル資金供給(10/1~10/8)		800	0.340	0.340		
米ドル資金供給(10/1~12/24)		0	0	0.330	0.330	
国債補完供給(9/29~9/30)	241	241	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
9月28日時点 6,057,300

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,409,900
9月30日以降の残り所要積数 3,600
平均 200

国庫短期証券入札予定

今月の国債買入オペ予定

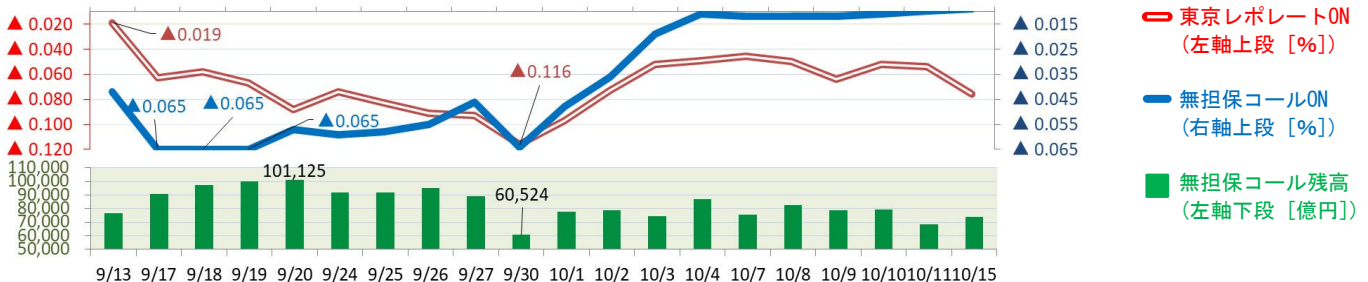
10月2日	3ヶ月	第941回
10月8日	6ヶ月	
10月9日	3ヶ月	
10月16日	3ヶ月	
10月1日	10年	
10月6日	30年	
10月8日	5年	
10月20日	20年	

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	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