

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年9月30日(水)

短期市場の推移

	9月24日	9月25日	9月28日	9月29日
加重平均金利	▲0.038	▲0.030	▲0.032	▲0.031
東京レポレート(ON)	▲0.102	▲0.101	▲0.094	▲0.103
無コール残	112,935	120,757	109,736	117,692
ON	73,522	77,414	69,073	78,569
その他	39,413	43,343	40,663	39,123
有コール残	19,340	23,014	22,158	20,897

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。

10月1日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50	7-9月期日銀短観(大企業製造業DI)	-22	18:00 (欧)8月失業率 8.1%
13:00	日銀当座預金増減要因と金融調節(9月実績)	-	21:30 (米)8月個人消費支出(PCE)価格コア指数[前年比] 1.5%
			23:00 (米)9月ISM製造業景況指数 55.5

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	▲0.061	▲0.102
T/N	▲0.030	▲0.001	▲0.008	▲0.096
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.030	▲0.097
2W	▲0.045	0.000	▲0.039	▲0.101
3W	-	-	-	▲0.106
1M	▲0.020	0.180	▲0.010	▲0.112
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.080	▲0.129
6M	-	-	-	▲0.144
1Y	-	-	-	▲0.164

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▲0.050%の出合から始まり、その後は主に▲0.070%~▲0.040%の水準で出合が見られた。9月末初物の調達を控える先が見られたため、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.030%の▲0.061%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.070	▲0.085 ~ ▲0.070	▲0.080 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

調達を控えていた先が戻り、出合水準は本日対比で上昇する見込み。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	9月30日	10月1日	9月30日	10月1日	10月2日
券	▲300	▲900	▲300	▲900	▲1,000
財政	▲1,100	▲29,200	▲1,100	▲29,200	▲68,000
過不足	▲1,400	▲30,100	▲1,400	▲30,100	▲69,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+10,000			
国債買入				+4,600	
CP等買入	▲11,500		▲300		
ETF買入				+800	
国債補完供給	+200	▲2,400	+2,400		
米ドル資金供給用担保国債供給					+1,600
当座預金増減	▲5,100	▲22,600	▲5,100	▲22,600	▲67,400
当座預金残高	4,874,600	4,852,000	4,874,600	4,852,000	4,784,600
準備預金残高	4,258,000		4,258,000		
積み終了先	4,257,900		4,257,900		
超過準備	4,254,600		4,254,600		
非準備先残高	616,600		616,600		
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		
平均	50.0%		50.0%		
乖離率	49.9%		49.9%		

9月30日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(10/1~)						
~1年	1,000	2,010	1,002	0.008	0.010	97.7
3~5年	3,500	11,710	3,505	▲0.001	0.000	59.1
国債補完供給(9/30~10/1)						
		2,360	2,360	▲0.350	▲0.350	
		27	27	▲0.350	▲0.350	

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	
10月1日	10年	
10月6日	30年	
10月8日	5年	
10月20日	20年	

来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30日	3
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	5 9 14 21 26 30	9月28日	6
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	2 7 14 21 23 30	9月30日	6
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	5 9 14 21 30	9月28日	5
10年超25年以下	500~2,000	1,200	2 26	9月14日	2
25年超	0~500	300	9 26	9月28日	2
物価連動債	300	300	月2回程度	9月28日	2
変動利付債<偶数月>	500	1,000	月1回	8月5日	1

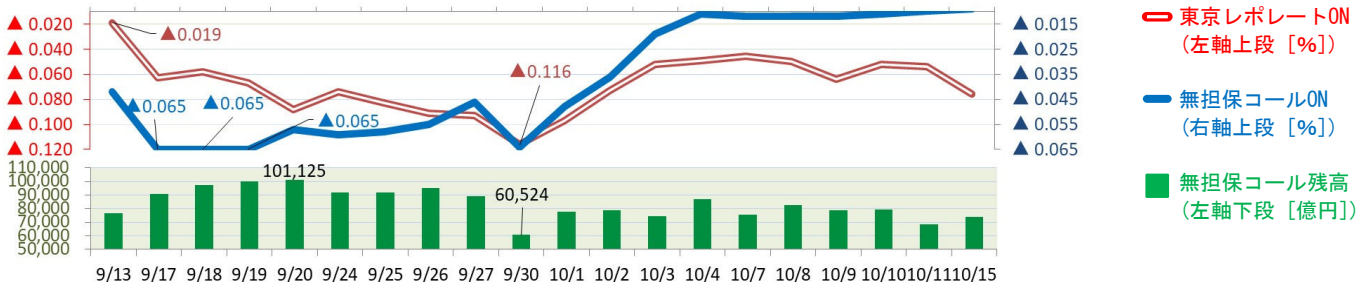
マナタリーベース [億円]
9月29日時点 6,065,000

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,409,900
10月1日以降の残り所要積数 200
平均 0

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