



短期市場の推移

	9月16日	9月17日	9月21日	9月22日
加重平均金利	▲0.026	▲0.022	▲0.022	▲0.021
東京レポレート(TN)	▲0.100	▲0.094	▲0.091	▲0.093
無コール残	146,593	155,934	155,594	161,437
ON	75,820	77,831	74,081	78,274
その他	70,773	78,103	81,513	83,163
有コール残	17,608	17,468	17,103	17,420

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	▲0.022	▲0.092
T/N	-	-	-	▲0.091
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	-	-	0.001	▲0.099
2W	-	-	-	▲0.099
3W	-	-	-	▲0.101
1M	-	-	▲0.010	▲0.101
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.108
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27日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	14:00	7月 景気動向指数 改定値 (内閣府)	-	(米) 8月 耐久財受注
	-	-	(米) NY連銀総裁 講演	-
	-	-	(米) 9月 グラス連銀 製造業活動	-

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▲0.008%の出合から始まり、その後は▲0.050%~▲0.003%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▲0.022%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.050	▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.055 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

週初も引き続き地銀業態を中心とした調達ニーズが強く、堅調な地合で推移すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月24日	9月27日	9月27日	9月28日	9月28日	9月28日
券	▲200		+600		+0	
財政	+2,900		▲7,300		+2,000	
過不足	+2,700		▲6,700		+2,000	
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
国債買入				+13,900		
CP等買入	▲300		▲400			
社債等買入	▲100	+800				
国債補完供給	+100	▲500	+500			
当座預金増減	+2,700		+7,300		+2,000	
当座預金残高	5,419,200		5,426,500		5,428,500	
準備預金残高	4,775,200					
積み終了先	4,774,900		国庫短期証券発行・償還(3M・6M)			
超過準備	4,774,900					
非準備先残高	644,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	36.7%					
乖離率	63.2%					

9月24日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(9/27~)						
1~3年	4,500	12,390	4,503	0.001	0.002	24.8
3~5年	4,500	14,011	4,503	0.010	0.010	88.0
5~10年	4,250	11,012	4,259	0.016	0.016	81.4
25年~	500	2,739	507	0.015	0.016	4.3
国債補完供給(9/24~9/27)						
	429	429	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース (億円)
9月22日時点 6,634,700

所要	今積期の所要準備額
9月27日以降の残り所要	3,615,500
積数	4,300
平均	200

国庫短期証券入札予定

10月1日	3ヶ月(第1027回)
10月7日	6ヶ月
10月8日	3ヶ月
10月15日	3ヶ月

国債入札予定

9月28日	40年
9月30日	2年
10月5日	10年
10月12日	30年

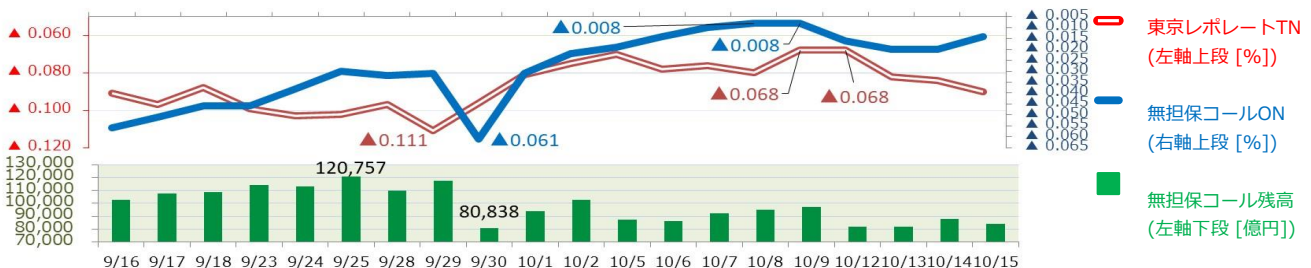
今月の国債買入オペ予定

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24日	0
3年超5年以下	4500	4,500	3 15 24 29	9月24日	1
5年超10年以下	4250	4,250	8 15 24 29	9月24日	1
10年超25年以下	1500	1,500	3	9月3日	0
25年超	500	500	24	9月24日	0
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	0

1年前の市場推移

○2020年9月積み期 [9月16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(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会