



短期市場の推移

	9月17日	9月21日	9月22日	9月24日
加重平均金利	▲0.022	▲0.022	▲0.021	▲0.022
東京レボレート(TN)	▲0.094	▲0.091	▲0.093	▲0.091
無コール残	155,934	155,594	161,437	165,371
ON	77,831	74,081	78,274	81,428
その他	78,103	81,513	83,163	83,943
有コール残	17,468	17,103	17,420	17,563

加重平均金利、コール残高は日銀、東京レボ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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.070	0.001	▲0.024	▲0.097
T/N	-	-	-	▲0.095
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	-	-	0.001	▲0.099
2W	-	-	-	▲0.099
3W	-	-	-	▲0.099
1M	-	-	▲0.010	▲0.101
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.109
6M	-	-	-	▲0.120
1Y	-	-	-	▲0.130

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

9月28日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	金融政策決定会合議事要旨 (7月15~16日分) (日銀)		23:00	(米) 9月消費者信頼感指数	115.0
	黒田総裁記者会見要旨 (日銀)			-	
	-			-	

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▲0.040%の出合から始まり、その後は▲0.060%~▲0.004%の水準で出合が見られた。市場の動向に大きな変化はなく、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.024%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲ 0.055 ~ ▲ 0.053	▲ 0.050 ~ ▲ 0.050	▲ 0.060 ~ ▲ 0.004

翌営業日のマーケット

引き続き地銀業態を中心とした調達ニーズが強く、出合の水準は本日と横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月27日		9月28日		9月29日	
券	+500		+400		+0	
財政	▲8,400		+2,600		▲14,000	
過不足	▲7,900		+3,000		▲14,000	
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				
共通担保(全店)					▲2,900	
CP等買入	▲400					
国債補充供給	+500	▲200	+200			
当座預金増減	+5,900		+3,200		▲16,900	
当座預金残高	5,425,100		5,428,300		5,411,400	
準備預金残高	4,778,600		主な需給要因			
積み終了先	4,778,600		国債発行(40年)			
超過準備	4,778,000					
非準備先残高	646,500					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	40.0%					
乖離率	59.9%					

9月27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	按分
CP等買入(9/30~)	5,000	8,164	4,984	▲0.022	▲0.017	5.3
国債補充供給(9/27~9/28)	222	222	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース (億円)
9月24日時点 6,637,700

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,615,500
9月28日以降の残り所要	
積数	3,700
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
9月28日	40年
9月30日	2年
10月5日	10年
10月12日	30年

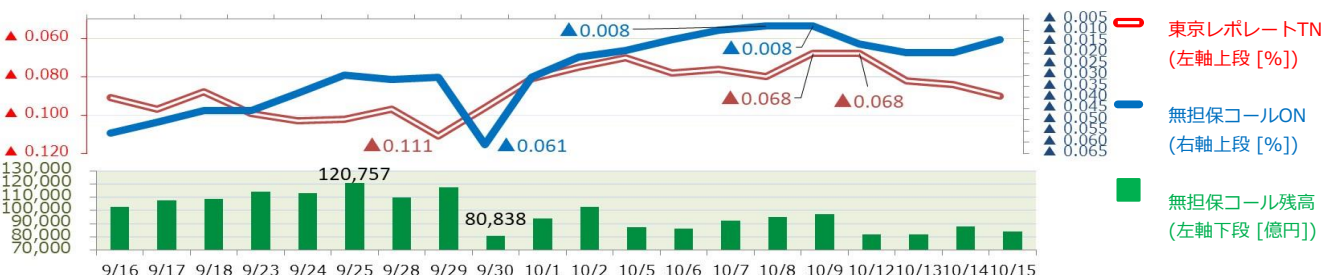
今月の国債買入オペ予定

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 24	9月3日	0
25年超	500	500		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