



短期市場の推移

	9月21日	9月22日	9月24日	9月27日
加重平均金利	▲0.022	▲0.021	▲0.022	▲0.024
東京レボレート(TN)	▲0.091	▲0.093	▲0.091	▲0.095
無コール残	155,594	161,437	165,371	166,222
ON	74,081	78,274	81,428	81,079
その他	81,513	83,163	83,943	85,143
有コール残	17,103	17,420	17,563	17,271

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	▲0.025	▲0.097
T/N	-	-	-	▲0.095
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	-	-	-	▲0.099
2W	-	-	-	▲0.100
3W	-	-	-	▲0.100
1M	▲0.015	0.180	0.003	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.050	▲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29日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(欧)ECBフォーラム [日米欧英中銀総裁が参加]	-
-	-	(米)アトランタ連銀総裁の講演	-
-	-	-	-

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▲0.015%の合出から始まり、その後は▲0.055%~▲0.010%の水準で合出が見られた。オファービッドともに昨日より大きな変化はなく、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.025%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.025 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

ビッドサイド動向に大きな変化はなく、出合の水準は本日と横ばい圏と予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	9月28日		9月29日		9月30日
券	+400		▲300		+0
財政	+3,500		▲17,100		▲2,100
過不足	+3,900		▲17,400		▲2,100
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				+1,000	
共通担保(全店)			▲2,900	+4,000	
CP等買入					+5,000
国債補充供給	+200				
当座預金増減	+4,100		▲16,100		+2,900
当座預金残高	5,429,200		5,413,100		5,416,000
準備預金残高	4,797,500		主な需給要因		
積み終了先	4,796,800		国債発行(40年)		
超過準備	4,796,800				
非準備先残高	631,700				
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	按分
国庫短期証券買入(9/29~)	1,000	8,847	1,003	0.005	0.006	10.9
米ドル資金供給(9/30~10/7)	0	0	0.330	0.330		
国債補充供給(9/28~9/29)	6	6	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(9/29~10/13)	20,000	3,951	3,951			

マナタリベース (億円)
9月27日時点 6,643,100

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,615,500
9月29日以降の残り所要	
積数	3,000
平均	200

国庫短期証券入札予定

9月3日	3ヶ月
9月9日	6ヶ月
9月10日	3ヶ月
9月16日	1年
9月30日	2年
9月2日	10年
9月7日	30年
9月9日	5年

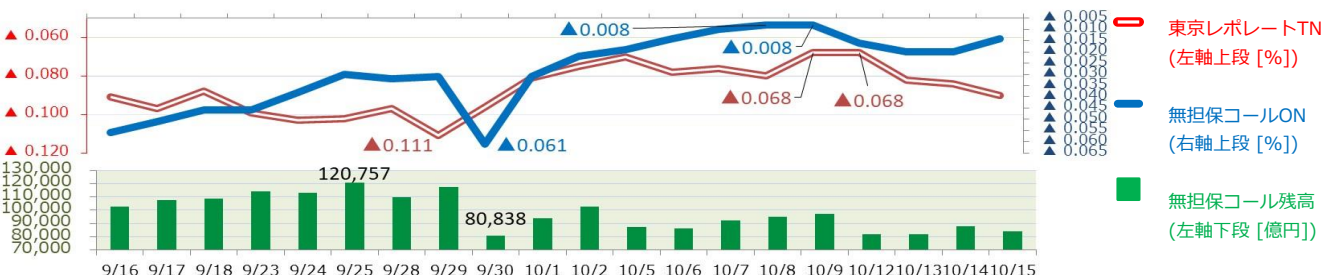
今月の国債買入オペ予定

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	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