



短期市場の推移

[億円] [%]

	9月22日	9月24日	9月27日	9月28日
加重平均金利	▲0.021	▲0.022	▲0.024	▲0.025
東京レボレート(TN)	▲0.093	▲0.091	▲0.095	▲0.095
無コール残	161,437	165,371	166,222	163,865
ON	78,274	81,428	81,079	75,962
その他	83,163	83,943	85,143	87,903
有コール残	17,420	17,563	17,271	17,356

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	▲0.087
T/N	-	-	▲0.001	▲0.108
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.055	0.045	▲0.014	▲0.098
2W	▲0.035	▲0.001	▲0.013	▲0.098
3W	▲0.001	0.001	0.000	▲0.099
1M	▲0.012	0.000	▲0.005	▲0.099
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30日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	鉱工業生産指数 (前月比)	▲0.5%	21:30 (米) 新規失業保険申請件数	
	-		21:30 (米) 国内総生産 (GDP) 改定値 (前期比年率)	6.8%
	-		-	-

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%の出会いから始まり、その後は▲0.055%～▲0.008%の水準で出会いが見られた。市場の動向に大きな変化はなく、同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.025%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.025 ~ ▲0.008

翌営業日のマーケット

四半期末日の取引に当たるため調達を見合わせる先が多く、出会い水準は本日対比低下を予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	9月29日	9月30日	10月1日
券	▲500	▲300	▲1,000
財政	▲11,900	▲7,800	▲20,000
過不足	▲12,400	▲8,100	▲21,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+1,000		スタート
国債買入		+9,500	
共通担保(全店)	▲2,900	+4,000	
CP等買入	▲800	▲5,800	+5,000
国債補充供給	▲100	+100	
当座預金増減	▲11,200	+700	▲21,000
当座預金残高	5,418,000	5,418,700	5,397,700
準備預金残高	4,800,300		
積み終了先	4,799,300		
超過準備	4,799,300		
非準備先残高	617,700		
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	按分
国債買入(9/30~)						
3~5年	4,500	8,972	4,504	▲0.002	▲0.001	91.6
5~10年	4,250	9,663	4,262	▲0.005	▲0.004	85.7
物価連動	600	1,738	600	0.100	0.012	20.0
国債補充供給(9/29~9/30)						
	77	77	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

9月28日時点 6,646,800

所要

今積期の所要準備額 3,615,500

9月30日以降の残り所要

積数 1,900

平均 100

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30日	2年
10月5日	10年
10月12日	30年
10月14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29日	0
5年超10年以下	4250	4,250	8 15 24 29	9月29日	0
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	9月29日	0
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