



短期市場の推移

	9月28日	9月29日	9月30日	10月1日
加重平均金利	▲0.025	▲0.025	▲0.049	▲0.018
東京レポレート(TN)	▲0.095	▲0.108	▲0.082	▲0.079
無コール残	163,865	149,834	103,650	142,713
ON	75,962	62,111	53,702	69,555
その他	87,903	87,723	49,948	73,158
有コール残	17,356	18,271	16,321	17,270

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	▲0.065	0.001	▲0.017	▲0.082
T/N	-	-	▲0.010	▲0.081
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.003	0.001	▲0.001	▲0.082
2W	▲0.003	▲0.002	▲0.002	▲0.085
3W	-	-	▲0.003	▲0.092
1M	▲0.005	▲0.001	▲0.003	▲0.098
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.110
6M	-	-	-	▲0.121
1Y	-	-	0.145	▲0.131

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

10月5日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
黒田日銀総裁がTCFDサミットで挨拶		18:00 (欧)8月生産者物価指数[前年比]	-
-		21:30 (米)8月貿易収支	-705億米ドル
-		23:00 (米)9月ISM非製造業景況指数	59.8

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▲0.010%の出合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.003%の水準で出合が見られた。前日に引き続き、地銀業態を中心に調達ニーズが強く出合いの水準は上昇したため、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.017%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.015 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

引き続き地銀業態を中心に調達ニーズが強く、出合いの水準は上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	10月4日		10月5日		10月6日	
券	+400		+800		+0	
財政	▲42,500		+1,100		▲26,000	
過不足	▲42,100		+1,900		▲26,000	
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				+10,700		
CP等買入			▲100			
国債補完供給	+200	▲100	+100			
当座預金増減	▲42,000		+12,600		▲26,000	
当座預金残高	5,355,900		5,368,500		5,342,500	
準備預金残高	4,753,700		主な需給要因			
積み終了先	4,753,700		国債発行(10年)			
超過準備	4,753,700					
非準備先残高	602,200					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	63.3%					
乖離率	36.6%					

10月4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(10/5~)						
1~3年	4,500	11,595	4,507	▲0.003	▲0.002	45.9
3~5年	4,500	11,857	4,506	▲0.004	▲0.004	84.3
10~25年	1,500	4,578	1,512	▲0.004	▲0.004	53.1
国債補完供給(10/4~10/5)						
	45	45	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
10月1日時点 6,616,200

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,615,500
10月5日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

国債短期証券入札予定

10月7日	6ヶ月(第1028回)
10月8日	3ヶ月(第1029回)
10月15日	3ヶ月
10月19日	1年
国債入札予定	
10月5日	10年
10月12日	30年
10月14日	5年
10月19日	20年

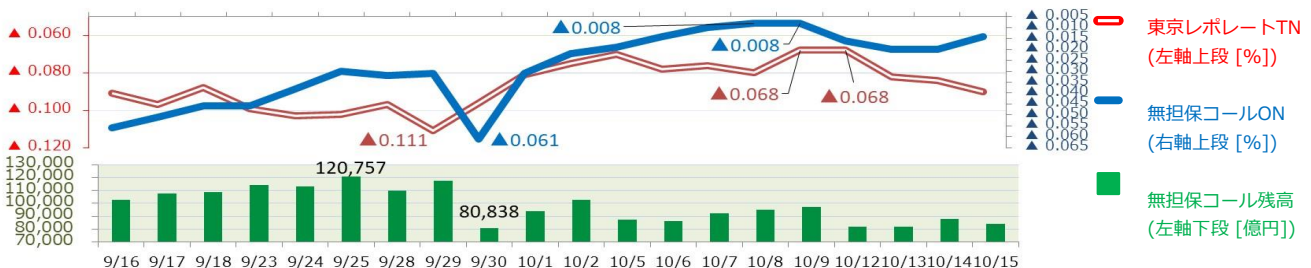
今月の国債買入オペ予定

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	1
1年超3年以下	4500	4,500	4 8 13 20	10月4日	3
3年超5年以下	4500	4,500	4 8 20 26	10月4日	3
5年超10年以下	4250	4,250	8 13 20 26	9月29日	4
10年超25年以下	1500	1,500	4	10月4日	0
25年超	500	500	20	9月24日	1
物価連動債	600	600	月1回	9月29日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	7月7日	-

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