



短期市場の推移

	9月1日	9月2日	9月3日	9月6日
加重平均金利	▲0.032	▲0.026	▲0.020	▲0.018
東京レポレート(TN)	▲0.080	▲0.075	▲0.075	▲0.070
無コール残	123,757	122,614	122,953	118,430
ON	61,069	60,391	60,600	55,827
その他	62,688	62,223	62,353	62,603
有コール残	18,721	18,652	18,576	18,649

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	▲0.060	0.001	▲0.014	▲0.071
T/N	-	-	-	▲0.071
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.012	0.250	0.037	▲0.075
2W	▲0.028	▲0.020	▲0.025	▲0.082
3W	-	-	▲0.015	▲0.091
1M	-	-	0.000	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.109
6M	-	-	-	▲0.121
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8日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本		海外	予想
	日本	予想		
8:50	4-6月期 GDP改定値 [前期比年率]	+1.6%	(米) 週間 MBA住宅ローン申請指数	-
8:50	7月国際収支 (経常収支)	22,627億円	(米) NY連銀総裁 講演	-
			(米) ページブック 公表	-

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▲0.025%~▲0.005%の水準で出合が見られた。都銀・地銀業態を中心に調達ニーズが強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.004%の▲0.014%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.025 ~ ▲0.025	▲0.020 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの動向に大きな変化はなく、引き続き堅調な地合が想定される。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月7日	9月8日	9月8日	9月9日	9月9日	9月9日
券	+900	+700		+0		+0
財政	▲400	▲13,400		+3,000		+3,000
過不足	+500	▲12,700		+3,000		+3,000
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
国庫短期証券買入				+1,000		
CP等買入			▲100			
社債等買入	▲200					+1,300
国債補完供給		▲100	+100			
当座預金増減	+200	▲11,700		+4,300		+4,300
当座預金残高	5,320,000	5,308,300		5,312,600		5,312,600
準備預金残高	4,670,000					
積み終了先	4,670,000					
超過準備	4,670,000					
非準備先残高	650,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	74.2%					
乖離率	25.7%					

9月7日のオペ結果

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国庫短期証券買入(9/8~)	1,000	9,578	1,000	0.007	0.008
----------------	-------	-------	-------	-------	-------

米ドル資金供給(9/9~9/16)

0	0	0.330	0.330
---	---	-------	-------

国債補完供給(9/7~9/8)

133	133	▲0.350	▲0.350
0	0		

マナリーベース	所要
9月6日時点	6,539,000

今積期の所要準備額	所要
9月8日以降の残り所要	3,736,800
積数	100
平均	0

国庫短期証券入札予定

9月9日	6ヶ月 第1021回
9月10日	3ヶ月 第1022回
9月16日	1年
9月17日	3ヶ月

国債入札予定

9月9日	5年
9月16日	20年
9月28日	40年
9月30日	2年

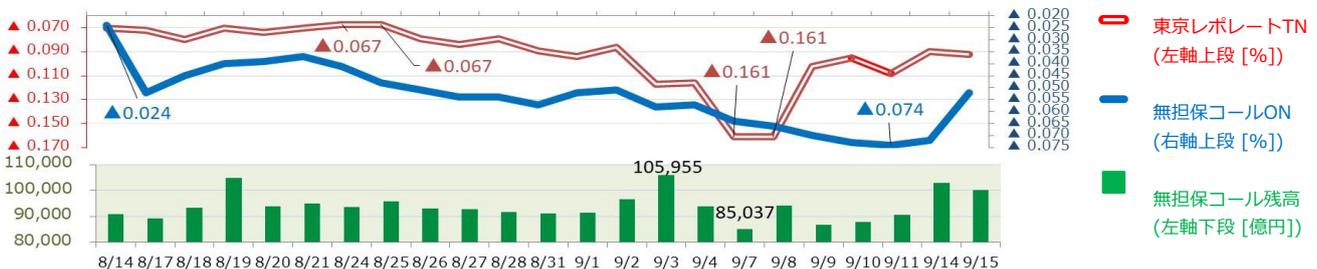
今月の国債買入オペ予定

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	8月30日	1
1年超3年以下	4500	4,500	3 8 15 24	9月3日	3
3年超5年以下	4500	4,500	3 15 24 29	9月3日	3
5年超10年以下	4250	4,250	8 15 24 29	8月30日	4
10年超25年以下	1500	1,500	3	9月3日	0
25年超	500	500	24	8月25日	1
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	-

1年前の市場推移

○2020年8月積み期 [8月14日~9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