



### 短期市場の推移

	9月2日	9月3日	9月6日	9月7日
加重平均金利	▲0.026	▲0.020	▲0.018	▲0.014
東京レポレート(TN)	▲0.075	▲0.075	▲0.070	▲0.071
無コール残	122,614	122,953	118,430	119,120
ON	60,391	60,600	55,827	55,397
その他	62,223	62,353	62,603	63,723
有コール残	18,652	18,576	18,649	18,391

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	▲0.009	▲0.072
T/N	-	-	-	▲0.076
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	0.001	▲0.007	▲0.078
2W	▲0.017	▲0.003	▲0.016	▲0.084
3W	-	-	0.000	▲0.092
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9日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	20:45 (欧)9月欧中銀 (ECB) 政策金利	0%
-	-	21:30 (米)新規失業保険 申請件数[前週分]	-
-	-	-	-

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+0.005%の▲0.009%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.015	▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.010 ~ ▲0.005

### 翌営業日のマーケット

引き続き堅調な地合が予想され、出合水準は本日対比で上昇を予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月8日	9月9日	9月8日	9月9日	9月10日	9月10日
券		+700		+200		+0
財政	▲12,600		▲1,000		▲31,000	
過不足	▲11,900		▲800		▲31,000	
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				
国債買入				+10,300		
CP等買入	▲100		▲400			
社債等買入				+1,300		
国債補完供給	+100					
当座預金増減	▲10,900		+10,400		▲31,000	
当座預金残高	5,309,100		5,319,500		5,288,500	
準備預金残高	4,674,900					
積み終了先	4,674,900					
超過準備	4,674,900					
非準備先残高	634,200					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	77.4%					
乖離率	22.5%					

### 9月8日のオペ結果

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国債買入(9/9~)						
~1年	1,500	1,949	1,501	▲0.005	0.002	11.6
1~3年	4,500	10,371	4,505	0.000	0.000	96.9
5~10年	4,250	10,695	4,264	0.006	0.007	14.6
国債補完供給(9/8~9/9)						
	2	2	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)  
9月7日時点 6,538,300

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,736,800
9月9日以降の残り所要	
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

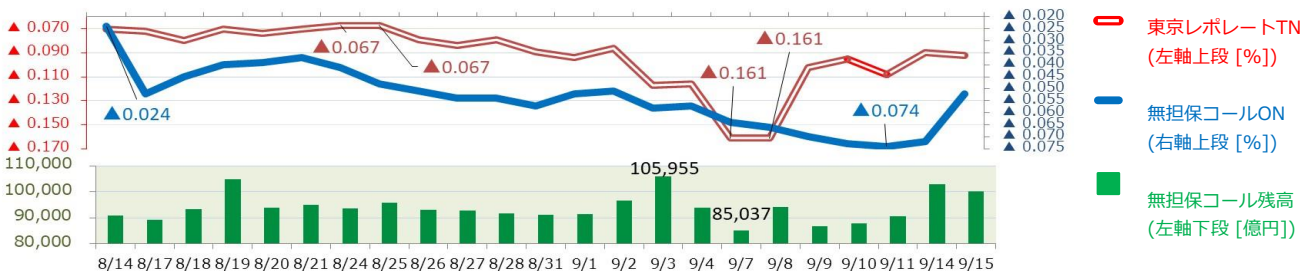
### 今月の国債買入オペ予定

オベ種類	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8日	2
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	9月8日	3
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