



短期市場の推移

[億円] [%]

	9月6日	9月7日	9月8日	9月9日
加重平均金利	▲0.018	▲0.014	▲0.009	▲0.006
東京レボレート(TN)	▲0.070	▲0.071	▲0.076	▲0.077
無コール残	118,430	119,120	117,462	137,054
ON	55,827	55,397	52,999	71,391
その他	62,603	63,723	64,463	65,663
有コール残	18,649	18,391	18,146	18,396

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	▲0.010	▲0.068
T/N	-	-	-	▲0.069
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	0.000	▲0.008	▲0.078
2W	-	-	-	▲0.086
3W	-	-	-	▲0.093
1M	-	-	0.000	▲0.100
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.108
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13日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	8月国内企業物価指数 [前年比]	+5.5%		-	
	-			-	
	-			-	

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

週末3日積みである本日の無担保コールON物は▲0.002%の出合から始まり、その後は主に▲0.035%~▲0.002%の水準で出合が見られた。一巡後には、一部の先で調達意欲の弱まりも見られ、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.004%の▲0.010%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.015	▲0.007 ~ ▲0.005	▲0.035 ~ ▲0.002

翌営業日のマーケット

8月積み期終盤で調達ニーズが減退する先も想定され、出合の水準は本日対比若干の低下を予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	9月10日	9月13日	9月14日
券	+900	+400	+0
財政	▲39,500	+6,400	+3,000
過不足	▲38,600	+6,800	+3,000
金融調節	エンド	エンド	エンド
CP等買入	▲400	▲200	
国債補充供給	▲200	+200	
当座預金増減	▲39,200	+6,800	+3,000
当座預金残高	5,280,500	5,287,300	5,290,300
準備預金残高	4,692,100	主な需給要因 国庫短期証券発行・償還(3M)	
積み終了先	4,692,100		
超過準備	4,692,100		
非準備先残高	588,400		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	90.3%		
乖離率	9.7%		

9月10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
------	------	----	----	----	----	----

CP等買入(9/15~)

5,000 9,995 4,992 ▲0.016 ▲0.013 68.5

国債補充供給(9/10~9/13)

170 170 ▲0.350 ▲0.350
0 0マナリーベース [億円]
9月9日時点 6,537,100

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,736,800
9月13日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国庫短期証券入札予定

9月16日	1年	第1023回
9月17日	3ヶ月	第1024回
9月21日	6ヶ月	
9月24日	3ヶ月	
国債入札予定		
9月16日	20年	
9月28日	40年	
9月30日	2年	
9月2日	10年	

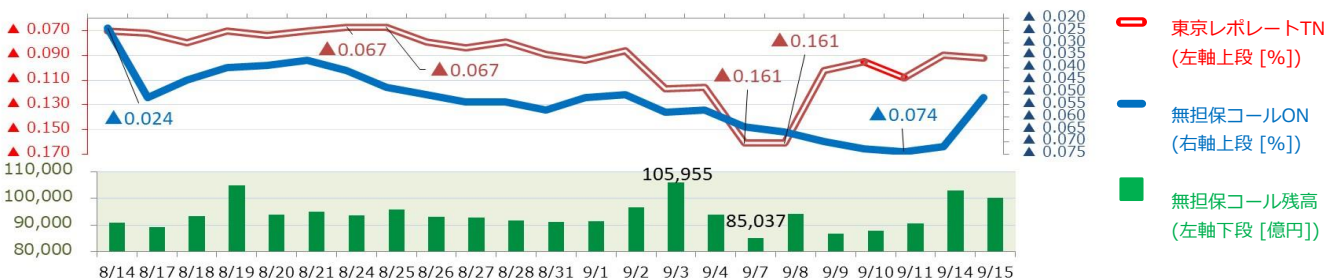
今月の国債買入オペ予定

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 24	9月3日	0
25年超	500	500		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