



短期市場の推移

	9月9日	9月10日	9月13日	9月14日
加重平均金利	▲0.006	▲0.010	▲0.016	▲0.024
東京レボレート(TN)	▲0.077	▲0.069	▲0.065	▲0.065
無コール残	137,054	134,844	126,279	127,287
ON	71,391	67,911	59,246	60,379
その他	65,663	66,933	67,033	66,908
有コール残	18,396	18,412	18,559	18,931

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	▲0.080	0.001	▲0.033	▲0.069
T/N	-	-	-	▲0.100
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.003	▲0.098
2W	▲0.050	0.000	▲0.009	▲0.098
3W	▲0.010	0.150	0.054	▲0.102
1M	▲0.020	▲0.015	▲0.017	▲0.102
2M	-	-	0.010	-
3M	-	-	0.010	▲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16日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	8月貿易収支	-601億円	18:00	(欧)7月貿易収支	-
17:00	8月業種別日銀当座預金残高		21:30	(米)8月小売売上高	-0.9%
			21:30	(米)9月フィラデルフィア連銀製造業景況指数	20.0

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▲0.040%の出合から始まり、その後は主に▲0.045%~▲0.02%の水準で出合が見られた。積み期最終日であったが調達ニーズは限定的であり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.009%の▲0.033%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.045	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.060 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

新積み期に入り、再度地銀業態の調達意欲増進が見込まれ、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15日	9月16日	9月16日	9月17日	9月17日
券	▲300	▲700	▲700	▲2,000	▲2,000
財政	▲7,800	+3,500	+3,500	▲7,000	▲7,000
過不足	▲8,100	+2,800	+2,800	▲9,000	▲9,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+1,000			
国債買入			+13,400		
共通担保(全店)	▲2,400	+2,900			
CP等買入	▲700	+5,000	▲100		
社債等買入	▲100				
国債補完供給	+200	▲400	+400		
貸出増加支援	▲32,600	+27,700			
当座預金増減	▲7,500	+16,500	+16,500	▲9,000	▲9,000
当座預金残高	5,284,800	5,301,300	5,301,300	5,292,300	5,292,300
準備預金残高	4,676,400				
積み終了先	4,676,400				
超過準備	4,676,400				
非準備先残高	608,400				
準備預金進捗率	100.0%				
平均	100.0%				
乖離率	0.0%				

9月15日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(9/16~)						
1~3年	4,500	8,886	4,507	0.000	0.001	80.7
3~5年	4,500	10,155	4,505	▲0.004	▲0.002	1.7
5~10年	4,250	8,696	4,257	▲0.005	▲0.004	70.0
国債補完供給(9/15~9/16)						
	381	381	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース (億円)
9月14日時点 6,507,800

所要	(億円)
来積み期の所要準備額	3,615,500
9月16日以降の残り所要	
積数	3,615,500
平均	120,500

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	第1025回
9月24日	3ヶ月	
9月16日	20年	
9月28日	40年	
9月30日	2年	
9月2日	10年	

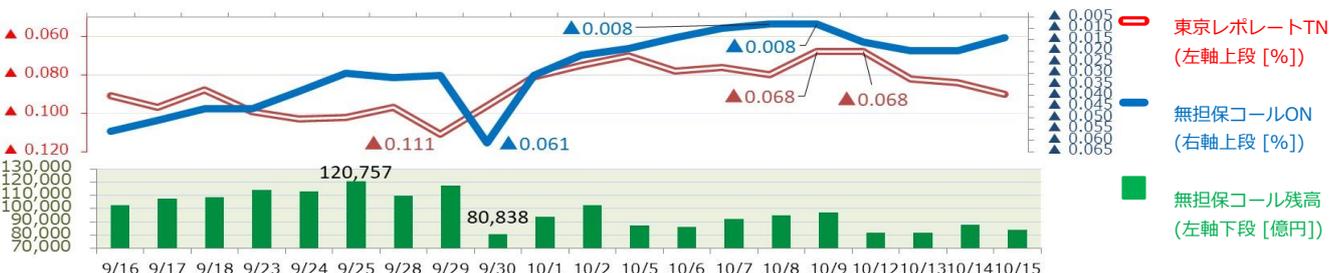
今月の国債買入オペ予定

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15日	1
3年超5年以下	4500	4,500	3 15 24 29	9月15日	2
5年超10年以下	4250	4,250	8 15 24 29	9月15日	2
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	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