



短期市場の推移

[億円] [%]

	9月10日	9月13日	9月14日	9月15日
加重平均金利	▲0.010	▲0.016	▲0.024	▲0.033
東京レボ レート(TN)	▲0.069	▲0.065	▲0.065	▲0.100
無コール残	134,844	126,279	127,287	121,829
ON	67,911	59,246	60,379	55,441
その他	66,933	67,033	66,908	66,388
有コール残	18,412	18,559	18,931	16,771

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	▲0.087	0.001	▲0.026	▲0.095
T/N	-	-	▲0.030	▲0.100
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.013	▲0.098
2W	▲0.010	▲0.001	▲0.005	▲0.101
3W	-	-	-	▲0.102
1M	-	-	▲0.001	▲0.102
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲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17日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-		17:00	(欧)7月経常収支	-
	-		23:00	(米)9月ミシガン大学消費者 信頼感指数速報	73.7
	-			-	

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

9月積み期初日の本日の無担保コールON物は▲0.050%の出合から始まり、その後は主に▲0.035%～▲0.010%の水準で出合が見られた。地銀業態を中心に調達に積極的な先も見られ、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.007%の▲0.026%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.060	～	▲0.060	▲0.040 ～ ▲0.040
			▲0.050 ～ ▲0.005

翌営業日のマーケット

4日積みの明日も引き続きビッドサイドの調達意欲は強く、出合水準は本日対比で上昇を予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	9月16日		9月17日		9月21日
券	▲800		▲300		+0
財政	+6,000		▲700		+81,000
過不足	+5,200		▲1,000		+81,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入		+13,400			
CP等買入	▲100		▲1,000		
社債等買入			▲1,300		
国債補充供給	+400	▲100	+100		
当座預金増減	+18,800		▲3,200		+81,000
当座預金残高	5,303,600		5,300,400		5,381,400
準備預金残高	4,653,100				
積み終了先	3,442,100		国債発行(20年)		大量償還・利払い
超過準備	1,462,200				国庫短期証券発行・償還(3M・1Y)
非準備先残高	650,500				
準備預金進捗率	88.3%				
平均	3.3%				
乖離率	84.9%				

9月16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
国債補充供給(9/16～9/17)	80	80	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

9月15日時点 6,500,500

所要

[億円]

今積期の所要準備額	3,615,500
9月17日以降の残り所要	
積数	424,600
平均	14,600

国庫短期証券入札予定

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3日	3ヶ月	
国債入札予定		
9月28日	40年	
9月30日	2年	
9月2日	10年	
9月7日	30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 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	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