



短期市場の推移

	9月13日	9月14日	9月15日	9月16日
加重平均金利	▲0.016	▲0.024	▲0.033	▲0.026
東京レボレート(TN)	▲0.065	▲0.065	▲0.100	▲0.100
無コール残	126,279	127,287	121,829	146,593
ON	59,246	60,379	55,441	75,820
その他	67,033	66,908	66,388	70,773
有コール残	18,559	18,931	16,771	17,608

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	▲0.022	▲0.097
T/N	-	-	▲0.025	▲0.094
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.019	▲0.001	▲0.009	▲0.095
2W	▲0.050	▲0.001	▲0.016	▲0.100
3W	-	-	-	▲0.101
1M	▲0.010	0.000	▲0.005	▲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21日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀の金融政策決定会合 (22日まで)		(米) FOMC (22日まで)	
-	-	-	-
-	-	-	-

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4日積みである本日の無担保コールON物は▲0.008%の出会いから始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.003%の水準で出会いが見られた。週末を跨ぐ取引にあたることから、調達水準を切り上げる先が見られ、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.004%の▲0.022%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.060	- ~ -	▲0.050 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

引き続き堅調な地合いが想定され、出会い水準は本日対比横ばいまたは若干の上昇を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月17日	9月21日	9月21日	9月22日	9月22日	9月22日
券		▲400		▲500		▲1,000
財政		▲3,400		+75,000		▲4,000
過不足		▲3,800		+74,500		▲5,000
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
CP等買入	▲1,000		▲400			
社債等買入	▲1,300					
国債補充供給	+100	▲300	+300			
新型コロナ対応金融支援特別						▲186,700
当座預金増減		▲6,300		+74,400		▲191,700
当座預金残高		5,297,300		5,371,700		5,180,000
準備預金残高		4,649,500				
積み終了先		4,649,200		大量償還・利払い		
超過準備		4,556,300		国庫短期証券発行・償還(3M・1Y)		
非準備先残高		647,800				
準備預金進捗率		99.8%				
平均		16.7%				
乖離率		83.2%				

9月17日のオペ結果

9月17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
------	------	----	----	----	----	----

社債等買入(9/24~)
 750 2,630 750 0.099 0.106 55.6

国債補充供給(9/17~9/21)
 252 252 ▲0.350 ▲0.350
 9 9 ▲0.350 ▲0.350

マナタリベース [億円]
 9月16日時点 6,520,100

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,615,500
9月21日以降の残り所要	
積数	6,000
平均	200

国庫短期証券入札予定

9月21日	6ヶ月 第1025回
9月24日	3ヶ月 第1026回
9月3日	3ヶ月
9月9日	6ヶ月
9月28日	40年
9月30日	2年
9月2日	10年
9月7日	30年

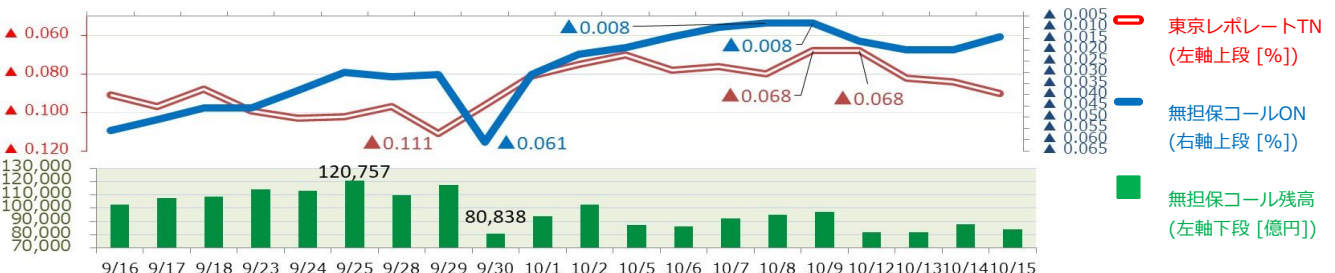
今月の国債買入オペ予定

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	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