



短期市場の推移

	9月15日	9月16日	9月17日	9月21日
加重平均金利	▲0.033	▲0.026	▲0.022	▲0.022
東京レポレート(TN)	▲0.100	▲0.100	▲0.094	▲0.091
無コール残	121,829	146,593	155,934	155,594
ON	55,441	75,820	77,831	74,081
その他	66,388	70,773	78,103	81,513
有コール残	16,771	17,608	17,468	17,103

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	▲0.070	0.001	▲0.021	▲0.092
T/N	▲0.020	▲0.010	▲0.016	▲0.093
S/N	-	-	▲0.005	-
1W	▲0.010	0.001	0.000	▲0.098
2W	▲0.015	▲0.001	▲0.008	▲0.099
3W	-	-	-	▲0.101
1M	-	-	-	▲0.102
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.108
6M	-	-	-	▲0.120
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24日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	8月消費者物価CPI指数 [前年比]	-	23:00	(米)8月新築住宅販売件数	71.3万戸
				(米)FRBオンラインイベント [パウエル議長らが参加]	
				(米)クリーブランド連銀 総裁の講演	

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▲0.008%の出会いから始まり、その後は▲0.050%~▲0.003%の水準で出会いが見られた。引き続き地銀業態を中心に調達意欲は強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001の▲0.021%となった。日本銀行は本日の金融政策決定会合にて、金融政策の現状維持を決定した。また、「気候変動対応を支援するための資金供給オペレーション基本要領」を公表した。

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

翌営業日のマーケット

週末3日積みで調達に積極的な姿勢を見せる先も想定され、出水準は本日比若干の上昇を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月22日		9月24日		9月27日	
券	▲700		▲200		+1,000	
財政	▲1,600		+6,600		▲7,000	
過不足	▲2,300		+6,400		▲6,000	
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	▲300		▲300			
社債等買入			▲100	+800		
国債補完供給	+200	▲100	+100			
新型コロナ対応金融支援特別	▲186,700	+241,800				
当座預金増減	+52,600		+6,900		▲6,000	
当座預金残高	5,416,500		5,423,400		5,417,400	
準備預金残高	4,779,100		主な需給要因			
積み終了先	4,779,000		国庫短期証券発行・償還(3M・6M)			
超過準備	4,778,900					
非準備先残高	637,400					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	26.7%					
乖離率	73.2%					

9月22日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(9/22~9/24)	80	80	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース (億円)
9月21日時点 6,581,500

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,615,500
9月24日以降の残り所要	
積数	5,300
平均	200

国庫短期証券入札予定

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10日	3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	

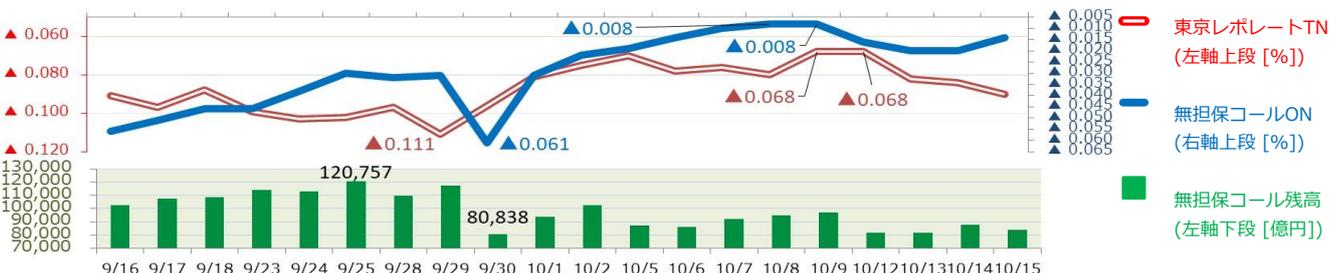
今月の国債買入オペ予定

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