



短期市場の推移

	8月26日	8月29日	8月30日	8月31日
加重平均金利	▲0.039	▲0.039	▲0.039	▲0.041
東京レポレート(TN)	▲0.097	▲0.095	▲0.105	▲0.101
無コール残	144,044	144,259	144,505	136,535
ON	65,026	66,031	66,517	65,692
その他	79,018	78,228	77,988	70,843
有コール残	28,354	28,718	28,577	27,602

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	▲0.044	▲0.093
T/N	▲0.045	▲0.029	▲0.040	▲0.097
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.040	▲0.105
2W	▲0.045	▲0.020	▲0.039	▲0.109
3W	-	-	-	▲0.118
1M	-	-	-	▲0.132
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.128
6M	-	-	-	▲0.147
1Y	-	-	-	▲0.144

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2日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 (米)8月非農業部門雇用者数	29.5万人
-	-	21:30 (米)8月失業率	3.5%
-	-	21:30 (米)8月平均時給[前年比]	5.2%

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▲0.030%の合出から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.040%の水準で取引された。オファーサイドが積極的な運用を行ったことで同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.003%の▲0.044%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.050	▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.055 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

週末3日積みみであるが、ビッドサイドが慎重な姿勢となることが想定され、出合いの水準は横ばい圏と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月1日	9月2日	9月2日	9月2日	9月5日	9月5日
券	▲200			+0		+1,000
財政	▲39,000			▲50,100		+3,000
過不足	▲39,200			▲50,100		+4,000
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
国債買入		+12,400				
CP等買入	▲300		▲400			
国債補充供給	+6,000	▲6,200	+6,200			
成長基盤強化支援			▲2,400			
当座預金増減	▲27,300		▲46,700			+4,000
当座預金残高	5,169,300		5,122,600			5,126,600
準備預金残高	4,511,900					
積み終了先	4,511,800					
超過準備	4,511,800					
非準備先残高	652,400					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	54.8%					
乖離率	45.1%					

9月1日のオペ結果

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国債買入(固定利回り方式)(9/2~)

5~10年 0 0

5~10年 0 0

5~10年 0 0

国債補充供給(9/1~9/2)

6,099 6,099 ▲0.350 ▲0.350

0 0

マネタリーベース (億円)

8月31日時点 6,449,900

所要

今積期の所要準備額 3,873,500

9月2日以降の残り所要

積数 700

平均 100

国庫短期証券入札予定

9月2日	3ヶ月(第1105回)
9月8日	6ヶ月(第1106回)
9月9日	3ヶ月
9月15日	1年

国債入札予定

9月6日	30年
9月13日	5年
9月15日	20年
9月27日	40年

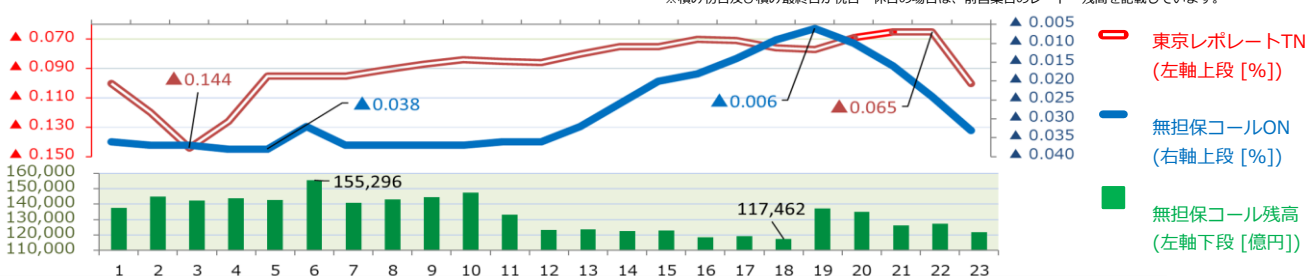
今月の国債買入オペ予定

オベ種類	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	8月3日	1
1年超3年以下	4750	4,750	2 7 14 26	8月24日	4
3年超5年以下	4750	4,750	2 7 14 26	8月31日	4
5年超10年以下	5000	5,000	7 14 26 30	8月31日	4
10年超25年以下	1250	1,250	2 30	8月31日	2
25年超	500	500	14 30	8月31日	2
物価運動債	600	600	月1回	8月31日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	7月13日	-

1年前の市場推移

○2021年8月積み期 [8月16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