



### 短期市場の推移

	8月29日	8月30日	8月31日	9月1日
加重平均金利	▲0.039	▲0.039	▲0.041	▲0.044
東京レポレート(TN)	▲0.095	▲0.105	▲0.101	▲0.097
無コール残	144,259	144,505	136,535	150,689
ON	66,031	66,517	65,692	68,076
その他	78,228	77,988	70,843	82,613
有コール残	28,718	28,577	27,602	29,178

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	▲0.075	0.001	▲0.048	▲0.092
T/N	▲0.055	▲0.030	▲0.050	▲0.090
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	0.005	▲0.040	▲0.098
2W	▲0.050	▲0.025	▲0.042	▲0.105
3W	-	-	-	▲0.114
1M	-	-	-	▲0.131
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.127
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5日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)休場 (レババーデー)	-
-	-	18:00 (欧)7月小売売上高 [前月比]	-
-	-	-	-

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▲0.045%の割合から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.040%の水準で取引された。昨日に引き続き、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▲0.004%の▲0.048%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.055	▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.060 ~ ▲0.040

### 翌営業日のマーケット

市場参加者の動向に大きな変化はなく、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2日		9月5日		9月6日	
券	+100		+900		+1,000	
財政	▲48,400		▲8,800		+0	
過不足	▲48,300		▲7,900		+1,000	
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				+10,900		
CP等買入	▲400		▲300			
国債補完供給	+6,200	▲6,700	+6,700			
成長基盤強化支援	▲2,400					
当座預金増減	▲51,600		+9,400		+1,000	
当座預金残高	5,117,700		5,127,100		5,128,100	
準備預金残高	4,464,000		主な需給要因			
積み終了先	4,463,900		国庫短期証券			
超過準備	4,463,900		発行・償還(3M)			
非準備先残高	653,700					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	64.5%					
乖離率	35.4%					

### 9月2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(固定利回り方式)(9/5~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(9/5~)						
1~3年	4,750	8,122	4,756	0.001	0.004	52.1
3~5年	4,750	8,678	4,753	0.010	0.012	12.5
10~25年	1,250	3,503	1,254	0.021	0.024	11.0
国債補完供給(9/2~9/5)						
	6,605	6,605	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)  
9月1日時点 6,422,800

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,873,500
9月5日以降の残り所要	
積数	400
平均	0

### 国庫短期証券入札予定

9月8日	6ヶ月(第1106回)
9月9日	3ヶ月(第1107回)
9月15日	1年
9月16日	3ヶ月

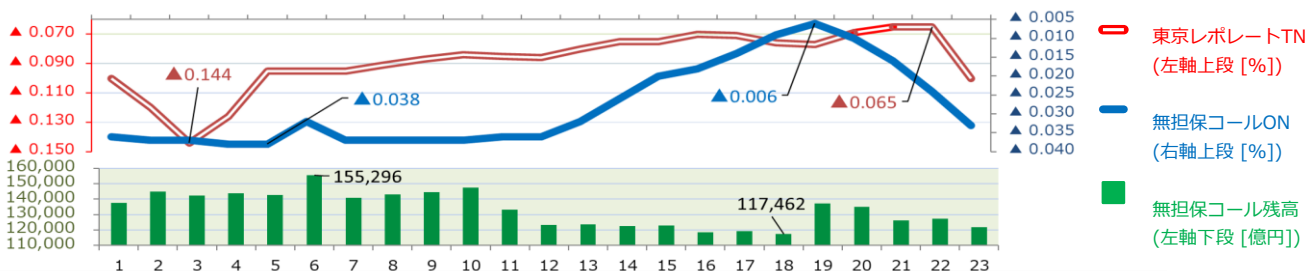
### 今月の国債買入オペ予定

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	8月3日	1
1年超3年以下	4750	4,750	2 7 14 26	9月2日	3
3年超5年以下	4750	4,750	2 7 14 26	9月2日	3
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	9月2日	1
25年超	500	500	14 30	8月31日	2
物価連動債	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