



短期市場の推移

	8月31日	9月1日	9月2日	9月5日
加重平均金利	▲0.041	▲0.044	▲0.048	▲0.047
東京レポレート(TN)	▲0.101	▲0.097	▲0.090	▲0.087
無コール残	136,535	150,689	156,100	142,847
ON	65,692	68,076	66,717	58,114
その他	70,843	82,613	89,383	84,733
有コール残	27,602	29,178	29,800	30,695

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	▲0.043	▲0.087
T/N	-	-	▲0.040	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.096
2W	▲0.005	▲0.003	▲0.004	▲0.103
3W	-	-	-	▲0.114
1M	-	-	-	▲0.134
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.129
6M	-	-	-	▲0.147
1Y	-	-	-	▲0.145

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7日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8月のコール市場残高(日銀)		(米) ページュブック	
貿易収支		(米) プレイナードFRB副議長の講演	
-	21:30	(米) 貿易収支	-701億米ドル

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▲0.040%の出合から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.035%の水準で取引された。ビッドサイドの調達ニーズが若干強く、ON物加重平均金利(速報)も前営業日対比+0.004%の▲0.043%となった。

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

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの動きの積極化を見込む。出合いの水準は本日対比で若干の上昇を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月6日		9月7日		9月8日	
券	+800		+600		+0	
財政	+13,800		▲10,600		▲3,000	
過不足	+14,600		▲10,000		▲3,000	
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
国庫短期証券買入				+1,000		
CP等買入	▲100					
国債補完供給	+7,200	▲7,500	+7,500			
当座預金増減	+14,200		▲1,500		▲3,000	
当座預金残高	5,131,700		5,130,200		5,127,200	
準備預金残高	4,498,400		主な需給要因			
積み終了先	4,498,300		国債発行(30年)			
超過準備	4,498,300					
非準備先残高	633,300					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	71.0%					
乖離率	28.9%					

9月6日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(9/7~)	1,000	4,085	1,000	0.015	0.015	79.8
国債買入(固定利回り方式)(9/7~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(9/8~9/15)	0	0	2,580	2,580		
国債補完供給(9/6~9/7)	7,412	7,412	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
9月5日時点 6,370,100

所要	今積期の所要準備額
9月7日以降の残り所要	3,873,500
積数	300
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

国債入札予定

9月13日	5年
9月15日	20年
9月27日	40年
9月29日	2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	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