



短期市場の推移

	9月1日	9月2日	9月5日	9月6日
加重平均金利	▲0.044	▲0.048	▲0.047	▲0.043
東京レボレート(TN)	▲0.097	▲0.090	▲0.087	▲0.086
無コール残	150,689	156,100	142,847	144,434
ON	68,076	66,717	58,114	60,016
その他	82,613	89,383	84,733	84,418
有コール残	29,178	29,800	30,695	31,465

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	▲0.073	0.001	▲0.041	▲0.089
T/N	-	-	▲0.044	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.040	▲0.093
2W	▲0.055	▲0.040	▲0.052	▲0.104
3W	-	-	-	▲0.112
1M	-	-	-	▲0.134
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.025	▲0.129
6M	-	-	-	▲0.147
1Y	-	-	-	▲0.146

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8日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	4-6月期国内総生産(GDP)改定値[前期比年率]	+2.9%	21:30 (米)新規失業保険申請件数[前週分]	-
8:50	7月国際収支(経常収支)	8616億円	(米)パウエルFRB議長講演	
14:00	8月景気ウオッチャー調査			

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▲0.035%の割合から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.035%の水準で取引された。ビッドサイドの調達ニーズは底堅く推移し、ON物加重平均金利(速報)も前営業日対比+0.002%の▲0.041%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.050	- ~ -	▲0.045 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

オファー、ビッド共に主だった動態変化は見られないため、横ばい圏での取引推移を想定する。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	9月7日	9月8日	9月9日
券	+500	▲100	+0
財政	▲11,700	▲5,600	▲8,000
過不足	▲11,200	▲5,700	▲8,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+1,000		
国債買入		+16,500	
CP等買入		▲200	
国債補完供給	+7,500	▲6,800	+6,800
貸出増加支援		▲23,600	
当座預金増減	▲9,500	▲6,200	▲8,000
当座預金残高	5,122,200	5,116,000	5,108,000
準備預金残高	4,502,400	主な需給要因	
積み終了先	4,502,300	流動性供給	
超過準備	4,502,300		
非準備預金残高	619,800		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	74.2%		
乖離率	25.7%		

9月7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)(9/8~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(9/8~)						
~1年	1,500	4,518	1,501	0.008	0.013	11.6
1~3年	4,750	14,763	4,752	0.002	0.004	41.6
3~5年	4,750	7,902	4,752	0.005	0.011	67.4
5~10年	5,500	10,745	5,505	0.016	0.020	91.9
国債補完供給(9/7~9/8)						
	6,754	6,754	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
9月6日時点 6,383,400

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,872,100
9月8日以降の残り所要	
積数	200
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

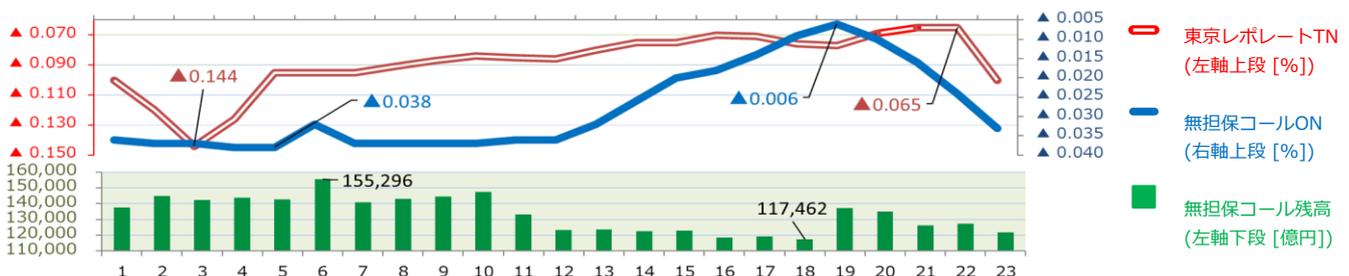
今月の国債買入オペ予定

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	9月7日	0
1年超3年以下	4750	4,750	2 7 14 26	9月7日	2
3年超5年以下	4750	4,750	2 7 14 26	9月7日	2
5年超10年以下	5500	5,500	7 14 26 30	9月7日	3
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	0
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	7月13日	0

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