



### 短期市場の推移

	9月2日	9月5日	9月6日	9月7日
加重平均金利	▲0.048	▲0.047	▲0.043	▲0.041
東京レポレート(TN)	▲0.090	▲0.087	▲0.086	▲0.086
無コール残	156,100	142,847	144,434	142,133
ON	66,717	58,114	60,016	62,795
その他	89,383	84,733	84,418	79,338
有コール残	29,800	30,695	31,465	32,175

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	▲0.068	0.001	▲0.037	▲0.086
T/N	-	-	▲0.023	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.042	▲0.040	▲0.040	▲0.092
2W	-	-	-	▲0.103
3W	-	-	-	▲0.113
1M	-	-	-	▲0.131
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.127
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9日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	ウォラーFRB理事、講演	-
-	-	シカゴ連銀総裁、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▲0.035%の合出から始まり、その後は主に▲0.045%~▲0.025%の水準で取引された。大手行の調達意欲が強まり、ON物加重平均金利(速報)も前営業日対比+0.004%の▲0.037%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.045 ~ ▲0.040	- ~ -	▲0.045 ~ ▲0.025

### 翌営業日のマーケット

週末3日積みのため、レート水準は一段の上昇を予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月8日		9月9日		9月12日	
券	▲100		+600		+1,000	
財政	▲6,500		▲3,900		▲13,000	
過不足	▲6,600		▲3,300		▲12,000	
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	+16,500		+200		-	
CP等買入	▲200		▲700		-	
社債等買入	-		▲100		-	
国債補完供給	+6,800	▲9,300	+9,300	-	-	-
貸出増加支援	▲23,600		-		-	
当座預金増減	▲16,400		+5,400		▲12,000	
当座預金残高	5,105,800		5,111,200		5,099,200	
準備預金残高	4,491,100		4,491,100		4,491,100	
積み終了先	4,491,100		流動性供給		国庫短期証券	
超過準備	4,491,100		-		発行・償還	
非準備先残高	614,700		-		(3M, 6M)	
準備預金進捗率	99.9%		-		-	
平均	77.4%		-		-	
乖離率	22.5%		-		-	

### 9月8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)(9/9~)	5~10年	225	225
5~10年	0	0	
5~10年	0	0	
国債補完供給(9/8~9/9)	9,025	9,025	▲0.350 ▲0.350
	100	100	▲0.350 ▲0.350

マネタリーベース (億円)  
9月7日時点 6,373,400

所要	今積期の所要準備額	3,872,100
9月9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9日	3ヶ月(第1107回)
9月15日	1年(第1108回)
9月16日	3ヶ月
9月21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	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