



### 短期市場の推移

	9月9日	9月12日	9月13日	9月14日
加重平均金利	▲0.030	▲0.032	▲0.033	▲0.033
東京レボレート(TN)	▲0.083	▲0.085	▲0.089	▲0.091
無コール残	157,143	140,797	143,023	150,829
ON	78,230	63,069	66,895	76,721
その他	78,913	77,728	76,128	74,108
有コール残	31,479	32,058	32,315	31,233

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	▲0.070	0.001	▲0.032	▲0.084
T/N	▲0.059	▲0.050	▲0.055	▲0.098
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.055	0.005	▲0.048	▲0.101
2W	▲0.055	▲0.003	▲0.033	▲0.105
3W	-	-	-	▲0.129
1M	0.014	0.200	0.034	▲0.130
2M	-	-	0.020	-
3M	-	-	0.010	▲0.128
6M	-	-	-	▲0.151
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16日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)9月ミシガン大学消費者信頼感指数速報	59.3
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.025%の出合から始まり、その後は主に▲0.040%~▲0.020%の水準で取引された。本日は積み最終日であったことから、着地に向けた取り調整の動きがあり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001の▲0.032%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.035	▲0.040 - ▲0.040	▲0.040 ~ ▲0.020

### 翌営業日のマーケット

積み初日となる明日は、ビットサイドが慎重な動きをとることも想定され、出合の水準は本日対比で低下を予想する。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	9月15日		9月16日		9月20日
券	▲400		▲300		+1,000
財政	▲9,300		▲13,700		+97,000
過不足	▲9,700		▲14,000		+98,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入	+12,400		+1,900		スタート
CP等買入	▲300		▲300		
社債等買入	▲100		▲300		
国債補充供給	+15,200	▲6,200	+6,200		
当座預金増減	+11,300		▲6,500		+98,000
当座預金残高	5,060,100		5,053,600		5,151,600
準備預金残高	4,458,200		主な需給要因		
積み終了先	4,458,200		国債発行・償還(20年)		大量償還・利払い
超過準備	4,458,200				
非準備先残高	601,900				
準備預金進捗率	100.0%				
平均	100.0%				
乖離率	0.0%				

### 9月15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)(9/16~)						
5~10年	1,869	1,869				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(9/15~9/16)						
	6,157	6,157	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース 【億円】  
9月14日時点 6,298,100

所要	【億円】
来積期の所要準備額	3,750,600
9月16日以降の残り所要	
積数	3,750,600
平均	125,000

### 国庫短期証券入札予定

9月16日	3ヶ月(第1109回)
9月21日	3ヶ月(第1110回)
9月30日	3ヶ月
10月6日	6ヶ月
9月27日	40年
9月29日	2年
10月4日	10年
10月12日	30年

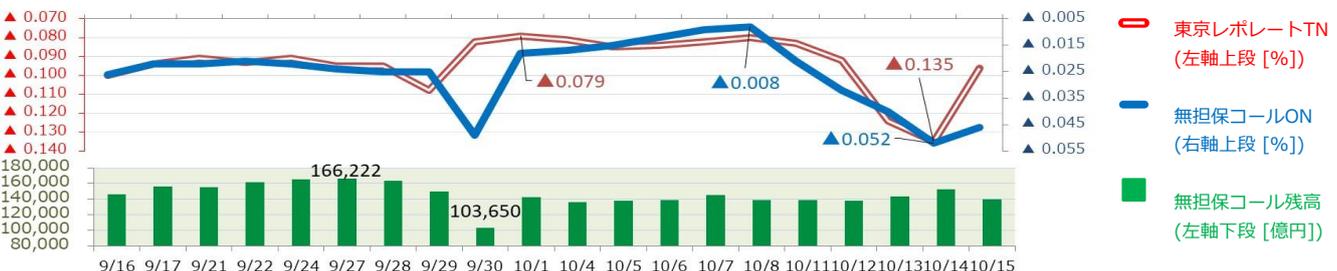
### 今月の国債買入オペ予定

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14日	1
3年超5年以下	4750	4,750	2 7 14 26	9月7日	1
5年超10年以下	5500	5,500	7 14 26 30	9月14日	2
10年超25年以下	1250	1,250	2 30	9月2日	1
25年超	500	500	14 30	9月14日	1
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9月積み期 [9月16日~10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