



短期市場の推移

[億円] [%]

	9月12日	9月13日	9月14日	9月15日
加重平均金利	▲0.032	▲0.033	▲0.033	▲0.032
東京レボレート(TN)	▲0.085	▲0.089	▲0.091	▲0.098
無コール残	140,797	143,023	150,829	142,981
ON	63,069	66,895	76,721	69,943
その他	77,728	76,128	74,108	73,038
有コール残	32,058	32,315	31,233	33,400

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	▲0.080	0.001	▲0.053	▲0.087
T/N	-	-	▲0.060	▲0.092
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.005	▲0.020	▲0.098
2W	▲0.067	▲0.025	▲0.051	▲0.123
3W	-	-	-	▲0.128
1M	-	-	-	▲0.128
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.127
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.145

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

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	9月16日	9月20日	9月21日
券	▲300	▲200	+0
財政	▲14,200	+88,500	▲13,000
過不足	▲14,500	+88,300	▲13,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	▲1,900	+4,400	スタート
CP等買入	▲300	▲500	
社債等買入	▲300	▲300	
国債補完供給	+6,200	+5,100	
当座預金増減	▲12,100	+97,000	▲13,000
当座預金残高	5,048,000	5,145,000	5,132,000
準備預金残高	4,421,700	主な需給要因	
積み終了先	4,417,400	大量償還・利払い	
超過準備	3,491,300		
非準備先残高	626,300		
準備預金進捗率	99.2%		
平均	13.3%		
乖離率	85.9%		

9月16日のオペ結果

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

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)(9/20～)

5～10年	4,458	4,458
5～10年	0	0
5～10年	0	0

社債等買入(9/22～)

750 1,602 750 0.063 0.143 83.8

国債補完供給(9/16～9/20)

5,079	5,079	▲0.350	▲0.350
20	20	▲0.350	▲0.350

マネタリーベース [億円]

9月15日時点 6,309,800

所要

今積期の所要準備額 3,750,600

9月20日以降の残り所要

積数 29,200

平均 1,100

国庫短期証券入札予定

9月21日	3ヶ月(第1110回)
9月30日	3ヶ月
10月6日	6ヶ月
10月7日	3ヶ月

国債入札予定

9月27日	40年
9月29日	2年
10月4日	10年
10月12日	30年

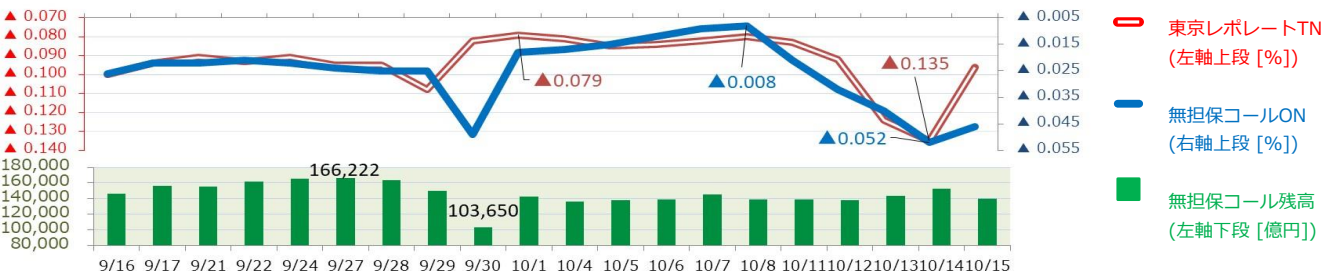
今月の国債買入オペ予定

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(登金)第 243号 加入協会 日本証券業協会