



### 短期市場の推移

	9月13日	9月14日	9月15日	9月16日
加重平均金利	▲0.033	▲0.033	▲0.032	▲0.053
東京レボレート(TN)	▲0.089	▲0.091	▲0.098	▲0.092
無コール残	143,023	150,829	142,981	137,596
ON	66,895	76,721	69,943	68,320
その他	76,128	74,108	73,038	69,276
有コール残	32,315	31,233	33,400	32,444

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	▲0.052	▲0.087
T/N	-	-	▲0.055	▲0.092
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	▲0.008	▲0.034	▲0.099
2W	▲0.060	▲0.055	▲0.057	▲0.130
3W	-	-	-	▲0.130
1M	-	-	0.005	▲0.130
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.129
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21日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀金融政策決定会合 (22日まで)		(米) FOMC (21日まで) パウエルFBR議長記者会見	
-		23:00 (米)8月中古住宅販売件数	473万件
-		-	-

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▲0.055%の合出から始まり、その後は主に▲0.055%~▲0.050%の水準で取引された。出し手取り手ともに動向に大きな変化は見られず、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.052%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.055	▲0.055 - ▲0.050	▲0.055 ~ ▲0.045

### 翌営業日のマーケット

大きな変化はなく、出合の水準は本日と横ばいを予想する。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月20日	9月21日	9月21日	9月22日	9月22日	9月22日
券		▲300		▲200		▲1,000
財政		+86,200		▲8,800		▲4,000
過不足		+85,900		▲9,000		▲5,000
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		+4,400		+8,300		
CP等買入	▲500		▲100			
社債等買入	▲300					
国債補充供給	+5,100	▲9,200	+9,200			
当座預金増減		+85,400		+8,400		▲5,000
当座預金残高		5,133,400		5,141,800		5,136,800
準備預金残高		4,494,900				
積み終了先		4,491,200				
超過準備		4,490,800				
非準備預金先高		638,500				
準備預金進捗率		99.3%				
平均		16.7%				
乖離率		82.7%				

### 9月20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)(9/21~)						
5~10年	8,361	8,361				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				

### 米ドル資金供給(9/22~9/29)

	0	0	3,260	3,260
国債補充供給(9/20~9/21)				
	9,032	9,032	▲0.350	▲0.350
	8	8	▲0.350	▲0.350

### マナリーベース [億円]

9月16日時点 6,298,000

### 所要 [億円]

今積期の所要準備額	3,750,600
9月21日以降の残り所要	
積数	25,100
平均	1,000

### 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

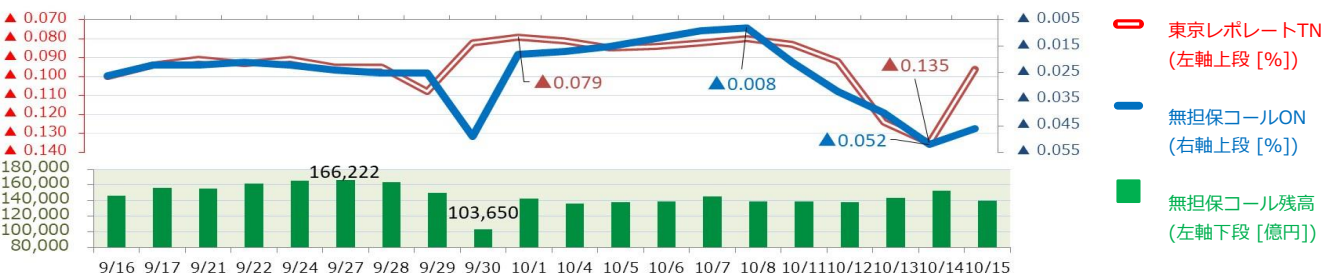
### 今月の国債買入オペ予定

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 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会