



短期市場の推移

	9月15日	9月16日	9月20日	9月21日
加重平均金利	▲0.032	▲0.053	▲0.052	▲0.052
東京レポレート(TN)	▲0.098	▲0.092	▲0.092	▲0.092
無コール残	142,981	137,596	134,922	133,860
ON	69,943	68,320	66,136	64,854
その他	73,038	69,276	68,786	69,006
有コール残	33,400	32,444	30,701	31,415

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	▲0.085	0.001	▲0.055	▲0.086
T/N	-	-	-	▲0.091
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.065	0.001	▲0.034	▲0.126
2W	-	-	-	▲0.132
3W	-	-	-	▲0.130
1M	-	-	-	▲0.129
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.131
6M	-	-	-	▲0.149
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26日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
黒田総裁挨拶 (大阪)		(欧) ラガルドECB総裁の講演	
-		-	
-		-	

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▲0.050%の合出から始まり、その後は主に▲0.065%~▲0.050%の水準で取引された。週末4日積みであったが調達ニーズは弱く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.003%の▲0.055%となった。本日開催された日銀金融政策決定会合では新型コロナ対応金融支援特別オペの延長を決定した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.065	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.065 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

引き続き調達ニーズは弱く、合出水準は本日対比若干の低下を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月22日		9月26日		9月27日	
券	▲900		+400		+0	
財政	▲1,900		+31,500		▲7,000	
過不足	▲2,800		+31,900		▲7,000	
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	+15,200		+3,700			
CP等買入	▲600		▲500			
社債等買入	▲100		+800			
国債補完供給	+6,300		+12,600			
当座預金増減	+6,200		+47,700		▲7,000	
当座預金残高	5,141,800		5,189,500		5,182,500	
準備預金残高	4,511,400		主な需給要因			
積み終了先	4,509,900		国庫短期証券発行・償還(3M)			
超過準備	4,509,300		国庫短期証券償還(6M)			
非準備先残高	630,400					
準備預金進捗率	99.6%					
平均	33.3%					
乖離率	66.3%					

9月22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)(9/26~)						
5~10年	3,713	3,713				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(9/22~9/26)						
	12,402	12,402	▲0.350	▲0.350		
	150	150	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)
9月21日時点 6,386,200

所要	今積期の所要準備額	9月26日以降の残り所要	積数	平均
	3,750,600		13,400	700

国庫短期証券入札予定

9月30日	3ヶ月(第1111回)
10月6日	6ヶ月
10月7日	3ヶ月
10月14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

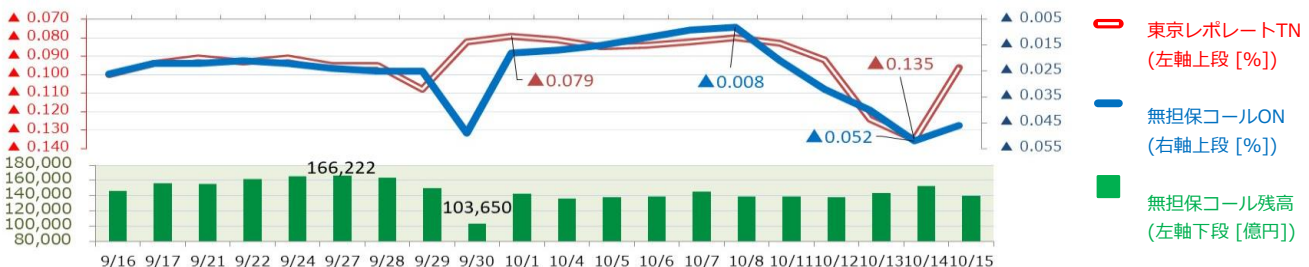
今月の国債買入オペ予定

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 26 30	9月7日	2
5年超10年以下	5500	1,500	7 14 26 30	9月21日	2
10年超25年以下	1250	1,000	2 30	9月21日	1
25年超	500	500	14 30	9月14日	1
物価運動債	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