



短期市場の推移

	9月21日	9月22日	9月26日	9月27日
加重平均金利	▲0.052	▲0.055	▲0.063	▲0.069
東京レポレート(TN)	▲0.092	▲0.091	▲0.091	▲0.091
無コール残	133,860	148,242	136,439	136,677
ON	64,854	79,085	69,092	68,430
その他	69,006	69,157	67,347	68,247
有コール残	31,415	31,182	31,270	31,556

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	▲0.087	0.001	▲0.068	▲0.087
T/N	-	-	-	▲0.092
S/N	-	-	▲0.055	-
1W	0.000	0.001	0.001	▲0.138
2W	▲0.060	▲0.035	▲0.044	▲0.132
3W	-	-	-	▲0.130
1M	-	-	-	▲0.129
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.005	▲0.129
6M	-	-	-	▲0.149
1Y	-	-	-	▲0.143

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29日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-		21:30	(米)4-6月期国内総生産(GDP)確定値[前期比年率]	-0.6%
	-		21:30	(米)新規失業保険申請件数[前週分]	-
	-			-	

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▲0.070%の合出から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.065%の水準で取引された。ビッドサイドの動向に大きな変化はなく、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.068%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.070	▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.075 ~ ▲0.065

翌営業日のマーケット

オファー・ビットともに大きな変化はなく、合出の水準は本日と横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	9月28日		9月29日		9月30日
券	+200		▲500		▲300
財政	▲21,100		▲1,200		▲2,900
過不足	▲20,900		▲1,700		▲3,200
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	+3,900		+2,500		
共通担保(全店)	▲7,300	+11,300			
CP等買入	▲600		▲500		+4,000
国債補完供給	+13,200	▲14,700	+14,700		
新型コロナ対応金融支援特別	▲287,700	+73,000			
当座預金増減	▲229,800		+15,000		+800
当座預金残高	4,928,100		4,943,100		4,943,900
準備預金残高	4,294,500		主な需給要因		
積み終了先	4,294,000				
超過準備	4,294,000				
非準備先残高	633,600				
準備預金進捗率	99.7%				
平均	43.3%				
乖離率	56.4%				

9月28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)(9/29~)						
5~10年	2,481	2,481				
5~10年	0	0				
国債補完供給(9/28~9/29)						
	14,628	14,628	▲0.350	▲0.350		
	1	1	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)
9月27日時点 6,408,600

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,750,600
9月29日以降の残り所要	
積数	10,500
平均	600

国債短期証券入札予定

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29日	2年
10月4日	10年
10月12日	30年
10月14日	5年

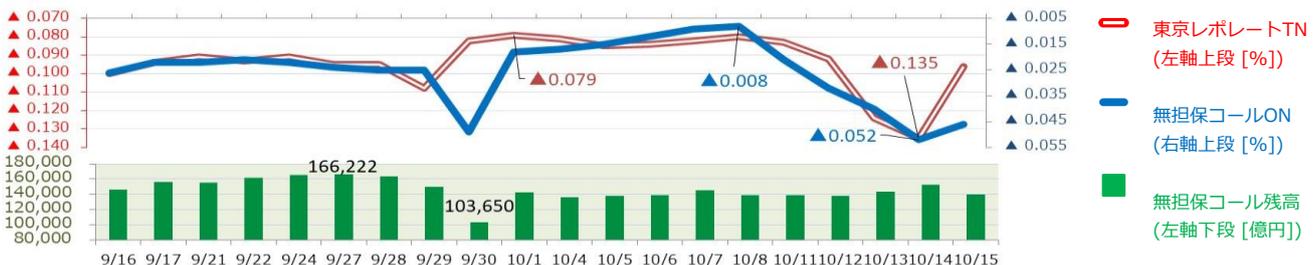
今月の国債買入オペ予定

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26日	0
3年超5年以下	4750	4,750	2 7 26 30	9月26日	1
5年超10年以下	5500	1,500	7 14 26 30	9月27日	1
10年超25年以下	1250	1,000	2 30	9月27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