



短期市場の推移

	9月26日	9月27日	9月28日	9月29日
加重平均金利	▲0.063	▲0.069	▲0.068	▲0.066
東京レボレート(TN)	▲0.091	▲0.091	▲0.092	▲0.118
無コール残	136,439	136,677	146,887	143,967
ON	69,092	68,430	80,190	78,260
その他	67,347	68,247	66,697	65,707
有コール残	31,270	31,556	32,315	32,493

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	▲0.087	0.001	▲0.073	▲0.091
T/N	-	-	-	▲0.097
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	▲0.065	▲0.068	▲0.104
2W	▲0.069	▲0.055	▲0.061	▲0.108
3W	-	-	-	▲0.118
1M	-	-	-	▲0.125
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.139
6M	-	-	-	▲0.152
1Y	-	-	-	▲0.144

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

10月3日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	8:50	7-9月期日銀短観 (大企業製造業DI)	11	23:00 (米)9月ISM製造業 景況指数
	金融政策決定会合における 主な意見 (9月21、22日分)			
	-			

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▲0.065%の合から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.060%の水準で取引された。四半期末である翌営業日に調達を控える先が散見された。その結果ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.007%の▲0.073%と2020年9月以来約2年ぶりの水準まで低下した。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.087	- ~ -	▲0.075 ~ ▲0.070

翌営業日のマーケット

本日ビッドを控えていた先が戻ってくるのが想定され、出会いの水準は上昇すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月30日	10月3日	10月3日	10月4日	10月4日	10月4日
券	+800	+400		+0		
財政	+6,100	▲29,500		▲45,000		
過不足	+6,900	▲29,100		▲45,000		
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	+8,700	+12,700				
CP等買入	▲4,100	+4,000	▲200			
国債補完供給	+18,000	▲27,600	+27,600			
当座預金増減	+5,900	+11,000		▲45,000		
当座預金残高	4,930,300	4,941,300		4,896,300		
準備預金残高	4,326,300					
積み終了先	4,326,000					
超過準備	4,324,100					
非準備先残高	604,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	56.7%					
乖離率	43.2%					

9月30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)(10/3~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(10/3~)						
3~5年	4,750	7,625	4,753	▲0.007	▲0.005	94.0
5~10年	5,500	6,219	5,503	▲0.014	▲0.006	15.7
10~25年	1,250	4,062	1,251	▲0.005	▲0.004	84.0
25年~	500	1,759	504	▲0.019	▲0.017	20.4
物価連動	600	2,208	600	▲0.420	▲0.467	43.2
国債補完供給(9/30~10/3)						
	27,451	27,451	▲0.350	▲0.352		
	105	105	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース	9月29日時点
6,175,500	

所要	今積期の所要準備額
3,750,600	
積数	3,400
平均	300

国債短期証券入札予定

10月6日	6ヶ月(第1112回)
10月7日	3ヶ月(第1113回)
10月14日	3ヶ月
10月19日	1年
10月4日	10年
10月12日	30年
10月14日	5年
10月18日	20年

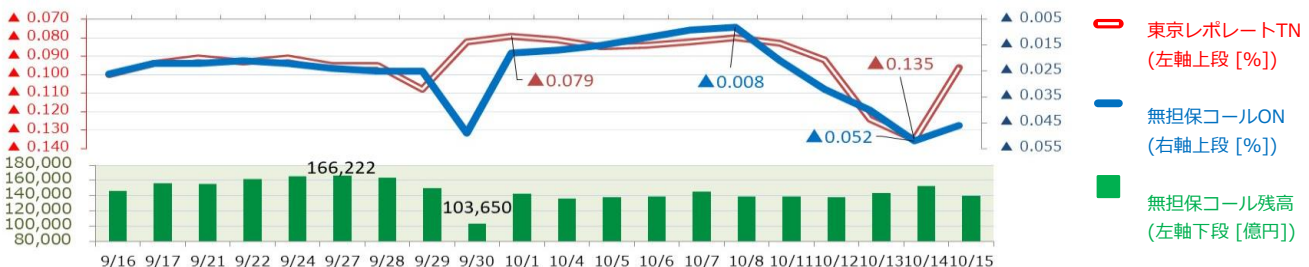
来月の国債買入オペ予定

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	1
1年超3年以下	4750	4,750	5 11 17 21	9月26日	4
3年超5年以下	4750	4,750	5 11 21 26	9月30日	4
5年超10年以下	5500	5,500	11 17 21 26	9月30日	4
10年超25年以下	2500	1,250	11 26	9月30日	2
25年超	1000	500	17 26	9月30日	2
物価連動債	600	600	月1回	9月30日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	7月13日	1

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