



## デイリーシグナル

2022年9月9日(金)

### 短期市場の推移

	9月5日	9月6日	9月7日	9月8日
加重平均金利	▲0.047	▲0.043	▲0.041	▲0.037
東京レボレート(TN)	▲0.087	▲0.086	▲0.086	▲0.086
無コール残	142,847	144,434	142,133	142,823
ON	58,114	60,016	62,795	64,990
その他	84,733	84,418	79,338	77,833
有コール残	30,695	31,465	32,175	31,429

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	▲0.065	0.001	▲0.030	▲0.086
T/N	-	-	▲0.040	▲0.083
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.005	▲0.032	▲0.091
2W	-	-	▲0.020	▲0.102
3W	-	-	-	▲0.119
1M	-	-	-	▲0.130
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.129
6M	-	-	-	▲0.147
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

### 9月12日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.025%の合出から始まり、その後は主に▲0.035%~▲0.020%の水準で取引された。週末3日積みのため調達ニーズは強く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.007%の▲0.030%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.030	- ~ -	▲0.050 ~ ▲0.018

### 翌営業日のマーケット

週末3日積み要因剥落のため、レート水準は低下を予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	9月9日	9月12日	9月12日	9月13日	9月13日
券		+700		+800	+0
財政		▲5,100		▲17,300	+2,000
過不足		▲4,400		▲16,500	+2,000
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		+200		+300	
CP等買入	▲700		▲400		
社債等買入	▲100		▲200		
国債補充供給	+9,300	▲7,200	+7,200		
当座預金増減		▲2,900		▲9,600	+2,000
当座預金残高		5,102,900		5,093,300	5,095,300
準備預金残高		4,495,500		4,495,500	主な需給要因
積み終了先		4,495,500		国庫短期証券発行・償還(3M、6M)	
超過準備		4,495,500			
非準備先残高		607,400			
準備預金進捗率		100.0%			
平均		87.1%			
乖離率		12.9%			

### 9月9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)(9/12~)						
5~10年	327	327				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
CP等買入(9/14~)	4,000	13,485	3,990	0.002	0.005	29.6
国債補充供給(9/9~9/12)						
	7,050	7,050	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

### マネタリーベース

9月8日時点 6,357,100

### 所要

今積期の所要準備額	9月12日以降の残り所要	積数	平均
3,872,100		0	0

### 国庫短期証券入札予定

9月15日	1年(第1108回)
9月16日	3ヶ月(第1109回)
9月21日	3ヶ月
9月30日	3ヶ月
9月13日	5年
9月15日	20年
9月27日	40年
9月29日	2年

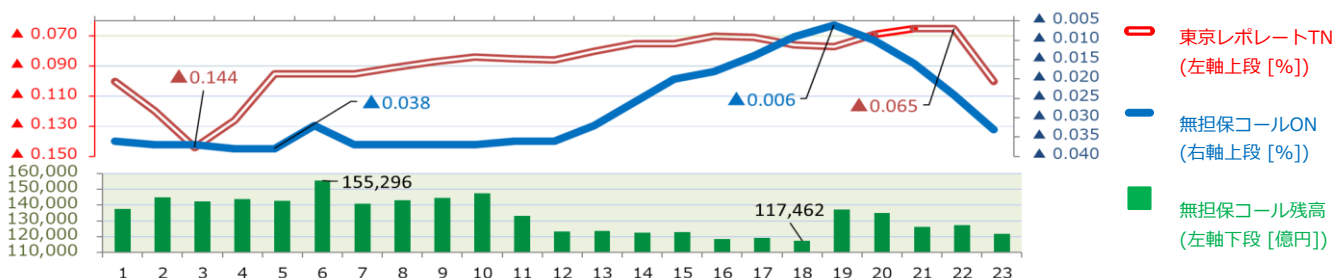
### 今月の国債買入オペ予定

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7日	2
3年超5年以下	4750	4,750	2 7 14 26	9月7日	2
5年超10年以下	5500	5,500	7 14 26 30	9月7日	3
10年超25年以下	1250	1,250	2 30	9月2日	1
25年超	500	500	14 30	8月31日	2
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8月積み期 [8月16日~9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