



デイリーシグナル

2022年9月12日(月)

短期市場の推移

	9月6日	9月7日	9月8日	9月9日
加重平均金利	▲0.043	▲0.041	▲0.037	▲0.030
東京レボレート(TN)	▲0.086	▲0.086	▲0.086	▲0.083
無コール残	144,434	142,133	142,823	157,143
ON	60,016	62,795	64,990	78,230
その他	84,418	79,338	77,833	78,913
有コール残	31,465	32,175	31,429	31,479

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	▲0.032	▲0.084
T/N	-	-	▲0.040	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.091
2W	-	-	0.100	▲0.100
3W	-	-	-	▲0.124
1M	-	-	-	▲0.129
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.128
6M	-	-	-	▲0.150
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13日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	8月国内企業物価指数[前年比]	+9.0%	21:30	(米)8月消費者物価コア指数[前年比]	6.1%
	-			-	
	-			-	

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▲0.040%~▲0.025%の水準で取引された。週末3日積み要因の剥落によりビットサイドの調達意欲は弱まり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.032%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.035	▲0.035 ~ ▲0.035	▲0.040 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

オファービッドとともに本日と大きな変化はなく、出合水準は横ばいと予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	9月12日		9月13日		9月14日
券	+800		+500		+0
財政	▲16,700		▲14,200		▲23,000
過不足	▲15,900		▲13,700		▲23,000
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	+300		+1,800		▲13,700
共通担保(全店)					+4,000
CP等買入	▲400		▲100		
社債等買入	▲200				
国債補充供給	+7,200	▲6,000	+6,000		
貸出増加支援					▲10,700
					+30,600
当座預金増減	▲15,000		▲6,000		▲12,800
当座預金残高	5,087,900		5,081,900		5,069,100
準備預金残高	4,481,000		4,481,000		4,481,000
積み終了先	4,481,000		4,481,000		4,481,000
超過準備	4,481,000		4,481,000		4,481,000
非準備預金残高	606,900		606,900		606,900
準備預金進捗率	100.0%		100.0%		100.0%
平均	90.3%		90.3%		90.3%
乖離率	9.7%		9.7%		9.7%

9月12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)(9/13~)						
5~10年	1,845	1,845				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(9/12~9/13)						
	5,908	5,908	▲0.350	▲0.350		
	0	0				
貸出増加を支援するための資金供給(9/14~2026/9/14)						
	30,590					

マナタリーベース	所要
9月9日時点	6,353,500
今積期の所要準備額	3,872,100
9月13日以降の残り所要	
積数	0
平均	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