



デイリーシグナル

2022年9月26日(月)

短期市場の推移

	9月16日	9月20日	9月21日	9月22日
加重平均金利	▲0.053	▲0.052	▲0.052	▲0.055
東京レボレート(TN)	▲0.092	▲0.092	▲0.092	▲0.091
無コール残	137,596	134,922	133,860	148,242
ON	68,320	66,136	64,854	79,085
その他	69,276	68,786	69,006	69,157
有コール残	32,444	30,701	31,415	31,182

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	▲0.063	▲0.085
T/N	-	-	▲0.065	▲0.091
S/N	-	-	-	-
1W	0.000	0.080	0.011	▲0.134
2W	-	-	-	▲0.129
3W	-	-	-	▲0.129
1M	-	-	-	▲0.128
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.130
6M	-	-	-	▲0.149
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

9月27日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
特になし		23:00 (米)9月消費者信頼感指数	104.0
-		23:00 (米)8月新築住宅販売件数	50.0万戸
-		-	-

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▲0.060%の合出から始まり、その後は主に▲0.070%~▲0.055%の水準で取引された。先週に比べビッドサイドの調達ニーズは大きく減退し、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.008%の▲0.063%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
▲0.080 ~ ▲0.075	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.070 ~ ▲0.060

翌営業日のマーケット

調達ニーズの減退は継続し、出合水準は本日対比低下と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月26日	9月27日	9月27日	9月28日	9月28日	9月29日
券		+300		+400		+0
財政		+33,400		▲36,000		▲17,000
過不足		+33,700		▲35,600		▲17,000
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
国庫短期証券買入				+1,000		
国債買入		+3,700		+16,000		
共通担保(全店)					▲7,300	
CP等買入	▲500		▲600			
社債等買入			▲300			
国債補完供給	+12,600	▲10,800	+10,800			
新型コロナ対応金融支援特別					▲287,700	
当座預金増減		+38,700		▲8,700		▲312,000
当座預金残高		5,180,500		5,171,800		4,859,800
準備預金残高		4,543,700	主な需給要因			
積み終了先		4,542,300				
超過準備		4,542,200				
非準備先残高		636,800				
準備預金進捗率		99.7%				
平均		36.7%				
乖離率		63.0%				

9月26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
国庫短期証券買入(9/27~)	1,000	6,100	1,000	0.013	0.013	
国債買入(固定利回り方式)(9/27~)						
5~10年	852	852				
5~10年	0	0				
国債買入(9/27~)						
1~3年	4,750	13,024	4,756	0.007	0.009	31.5
3~5年	4,750	10,240	4,752	0.018	0.019	72.1
5~10年	5,500	11,738	5,508	0.022	0.028	22.4
国債補完供給(9/26~9/27)						
	10,686	10,686	▲0.350	▲0.350		
	50	50	▲0.350	▲0.350		

マネタリベース [億円]	所要 [億円]
9月22日時点 6,393,200	今積期の所要準備額 3,750,600
	9月27日以降の残り所要積数 11,900
	平均 600

国庫短期証券入札予定

入札日	期間
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

入札日	期間
9月27日	40年
9月29日	2年
10月4日	10年
10月12日	30年

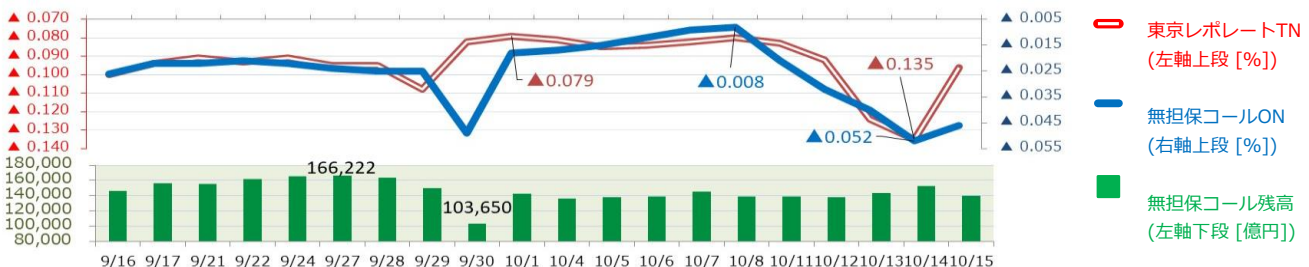
今月の国債買入オペ予定

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	5,500	7 14 26 30	9月26日	1
10年超25年以下	1250	1,250	2 30	9月2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