



短期市場の推移

	[億円] [%]			
	9月1日	9月4日	9月5日	9月6日
加重平均金利	▲0.060	▲0.069	▲0.072	▲0.076
東京レポレート(TN)	▲0.152	▲0.114	▲0.115	▲0.109
無コール残	175,041	169,172	173,963	158,837
ON	104,703	93,544	92,655	76,254
その他	70,338	75,628	81,308	82,583
有コール残	24,613	30,124	28,150	30,383

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	▲0.072	▲0.100
T/N	-	-	-	▲0.106
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	0.001	▲0.036	▲0.122
2W	▲0.070	0.030	▲0.045	▲0.129
3W	-	-	-	▲0.140
1M	-	-	-	▲0.162
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.138
6M	-	-	-	▲0.126
1Y	-	-	-	▲0.093

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8日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	7月国際収支		-	
	-		-	
	-		-	

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.073%の合出から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.070%の水準で取引された。積み終盤となりビッドサイドの調達目線は前営業日対比若干引きあがり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.004%の▲0.072%となった。

都銀・信託		証券	地銀
- ~ -	- ~ -	- ~ -	▲0.080 ~ ▲0.060

翌営業日のマーケット

週末でもあり調達を積極化させる先も一部見られるため、出合水準は本日対比上昇を想定。

資金需給

	[億円]					
	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月7日		9月8日		9月11日	
券	▲100		+400		+0	
財政	▲1,400		▲15,900		+11,000	
過不足	▲1,500		▲15,500		+11,000	
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
CP等買入	▲400		▲200			
社債等買入	▲100		▲200			
国債補完供給	+28,700	▲29,700	+29,700			
当座預金増減	▲3,000		+13,800		+11,000	
当座預金残高	5,402,300		5,416,100		5,427,100	
準備預金残高	4,709,400		主な需給要因			
積み終了先	4,708,900		国債発行(30年)		物価連動債償還(10年)	
超過準備	4,708,900				国庫短期証券発行・償還(3M)	
非準備先残高	692,900				国庫短期証券発行・償還(3M)	
準備預金進捗率	99.9%					
平均	74.2%					
乖離率	25.7%					

9月7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)(9/8~)						
5~10年	0	0	0			
5~10年	0	0	0			
5~10年	0	0	0			
国債補完供給(9/7~9/8)						
	30,114	30,114	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
 9月6日時点 6,662,400

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,018,100
9月8日以降の残り所要	
積数	1,800
平均	200

国債短期証券入札予定

9月8日	3ヶ月(第1181回)
9月15日	3ヶ月
9月19日	1年
9月21日	3ヶ月
9月12日	5年
9月14日	20年
9月26日	40年
9月28日	2年

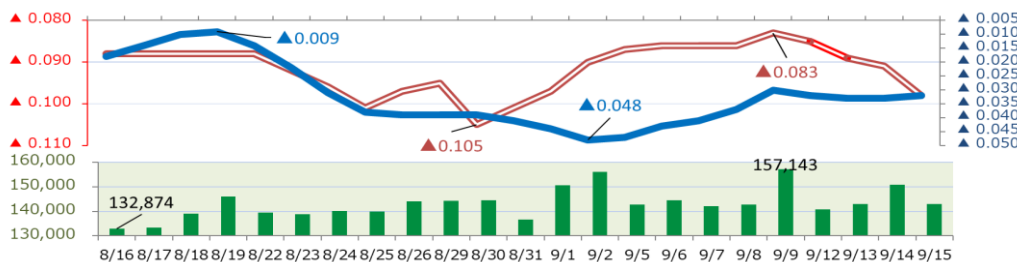
今月の国債買入オペ予定

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	8月16日	1
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	4 8 13 20	9月4日	3
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	4 8 20 27	9月4日	3
5年超10年以下	4,500~9,000	6,750	8 13 20 27	8月30日	4
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	4 8 20 27	9月4日	3
25年超	500~3,500	1,000	4 13 27	9月4日	2
物価連動債	600	600	月1回	8月30日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

1年前の市場推移

○2022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。



東京レポレート TN (左軸上段 [%])
 無担保コールON (右軸上段 [%])
 無担保コール残高

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