



短期市場の推移

	9月4日	9月5日	9月6日	9月7日
加重平均金利	▲0.069	▲0.072	▲0.076	▲0.072
東京レボレート(TN)	▲0.114	▲0.115	▲0.109	▲0.106
無コール残	169,172	173,963	158,837	156,664
ON	93,544	92,655	76,254	74,066
その他	75,628	81,308	82,583	82,598
有コール残	30,124	28,150	30,383	28,998

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	▲0.066	▲0.096
T/N	-	-	-	▲0.098
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.068	▲0.040	▲0.061	▲0.116
2W	-	-	▲0.069	▲0.125
3W	▲0.025	▲0.005	▲0.017	▲0.144
1M	-	-	-	▲0.162
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.137
6M	-	-	-	▲0.124
1Y	-	-	-	▲0.093

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11日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネーストック (8月)		-	
	-		-	
	-		-	

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.063%の合出から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.050%の水準で取引された。週末3日積のため一部ビッドサイドの調達意欲が強まり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.006%の▲0.066%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.075	- ~ -	▲0.078 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

オファーサイド・ビッドサイド共に変化は見られず、合出水準は本日対比横ばい圏を想定する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	9月8日	9月11日	9月11日	9月12日	9月12日
券	+300	+1,000	+1,000	▲1,000	
財政	▲16,100	+8,400	+8,400	▲2,000	
過不足	▲15,800	+9,400	+9,400	▲3,000	
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			+17,500		
CP等買入	▲200		▲300		
社債等買入	▲200		▲100		
国債補充供給	+29,700	▲24,400	+24,400		
当座預金増減	▲10,900	+50,900	+50,900	▲3,000	
当座預金残高	5,391,400	5,442,300	5,442,300	5,439,300	
準備預金残高	4,696,900				主な需給要因
積み終了先	4,696,500				物価連動債償還 (10年)
超過準備	4,696,500				国庫短期証券発行・償還 (3M)
非準備預金先高	694,500				国庫短期証券発行・償還 (6M)
準備預金進捗率	99.9%				
平均	83.9%				
乖離率	16.0%				

9月8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)(9/11~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				

国債買入(9/11~)						
1~3年	4,250	6,112	4,254	▲0.008	▲0.005	93.3
3~5年	4,500	12,292	4,504	▲0.015	▲0.014	26.7
5~10年	6,750	13,663	6,760	▲0.020	▲0.017	52.7
10~25年	2,000	4,079	2,006	▲0.018	▲0.013	71.2

CP等買入(9/13~)						
4,000	7,530	4,000	▲0.003	0.008	12.5	

国債補充供給(9/8~9/11)						
24,811	24,811	▲0.350	▲0.352			
0	0					

マナタリベース	所要
9月7日時点	6,659,400

所要	所要
今積期の所要準備額	4,018,100
9月11日以降の残り所要	
積数	500
平均	100

国庫短期証券入札予定

9月15日	3ヶ月(第1182回)
9月19日	1年
9月21日	3ヶ月
9月29日	3ヶ月

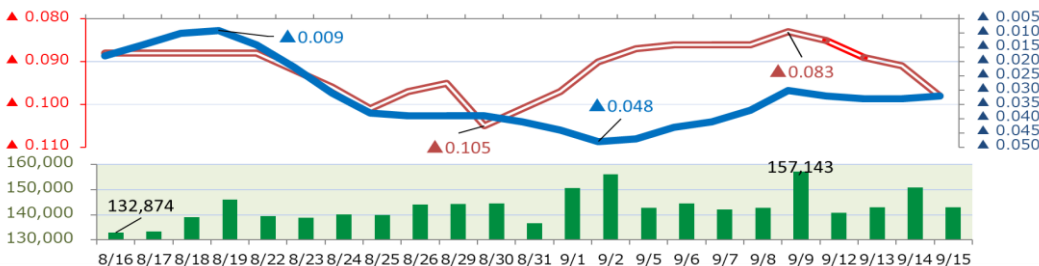
今月の国債買入オペ予定

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8日	2
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	4 8 20 27	9月8日	2
5年超10年以下	4,500~9,000	6,750	8 13 20 27	9月8日	3
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	4 8 20 27	9月8日	2
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。



- 東京レボレートTN (左軸上段 [%])
- 無担保コールON (右軸上段 [%])
- 無担保コール残高 (左軸下段 [億円])

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