



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	▲0.072	▲0.076	▲0.072	▲0.066
東京レポレート(TN)	▲0.115	▲0.109	▲0.106	▲0.098
無コール残	173,963	158,837	156,664	140,845
ON	92,655	76,254	74,066	65,567
その他	81,308	82,583	82,598	75,278
有コール残	28,150	30,383	28,998	31,062

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	▲0.060	▲0.097
T/N	-	-	-	▲0.095
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.117
2W	-	-	-	▲0.125
3W	-	-	-	▲0.151
1M	-	-	-	▲0.159
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.137
6M	-	-	-	▲0.124
1Y	-	-	-	▲0.091

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12日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想

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%~▲0.050%の水準で取引された。積み終盤を迎え、最終調整の取り意欲も一部の見られON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.006%の▲0.060%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.070 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

翌営業日のマーケットは一部取り手の調達意欲上昇を背景に本日対比上昇を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月11日	9月12日	9月12日	9月13日	9月13日	9月13日
券	+1,000	+700	+700	+0	+0	+0
財政	+7,900	▲300	▲300	▲35,000	▲35,000	▲35,000
過不足	+8,900	+400	+400	▲35,000	▲35,000	▲35,000
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
国債買入		+17,500				
共通担保(全店)					▲8,800	
CP等買入	▲300		▲400			+4,000
社債等買入	▲100					
国債補充供給	+24,400	▲27,400	+27,400			
当座預金増減	+23,000	+27,400	+27,400	▲39,800	▲39,800	▲39,800
当座預金残高	5,414,400	5,441,800	5,441,800	5,402,000	5,402,000	5,402,000
準備預金残高	4,739,400					
積み終了先	4,739,300					
超過準備	4,739,100					
非準備先残高	675,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	87.1%					
乖離率	12.8%					

9月11日のオペ結果

オベ種類 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	0	0
5~10年	0	0	
5~10年	0	0	

国債補充供給(9/11~9/12)	27,767	27,767	▲0.350	▲0.351
	0	0		

マネタリーベース	9月8日時点	6,648,200
----------	--------	-----------

所要	今積期の所要準備額	4,018,100
9月12日以降の残り所要	積数	300
	平均	100

国債短期証券入札予定

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

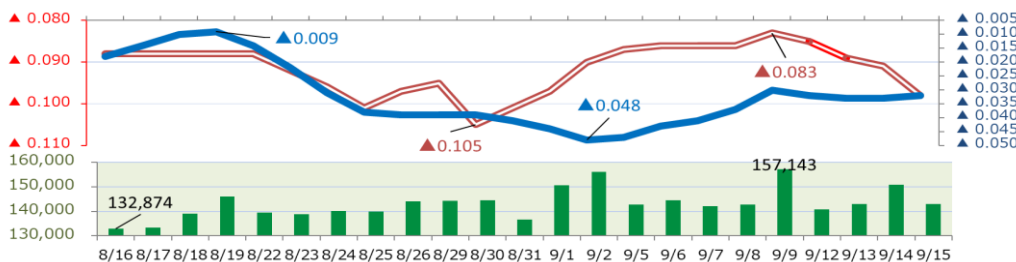
今月の国債買入オペ予定

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