



短期市場の推移

	9月6日	9月7日	9月8日	9月11日
加重平均金利	▲0.076	▲0.072	▲0.066	▲0.060
東京レポレート(TN)	▲0.109	▲0.106	▲0.098	▲0.095
無コール残	158,837	156,664	140,845	148,998
ON	76,254	74,066	65,567	74,820
その他	82,583	82,598	75,278	74,178
有コール残	30,383	28,998	31,062	28,994

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	▲0.048	▲0.096
T/N	-	-	-	▲0.095
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.040	▲0.117
2W	-	-	-	▲0.122
3W	-	-	-	▲0.150
1M	-	-	-	▲0.156
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.025	▲0.136
6M	-	-	-	▲0.124
1Y	-	-	-	▲0.086

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13日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	8月の企業物価指数 (日銀)		21:30	8月の消費者物価	
	-			-	
	-			-	

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.050%の合出から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.045%の水準で取引された。前日に引き続きビッドサイドの調達ニーズは強く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.012%の▲0.048%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.050 ~ ▲0.045

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲は強く、出合の水準は本日対比上昇すると予想。

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12日	9月13日	9月14日	9月15日
券	+800	+200	+800	+200	+1,000	+1,000
財政	▲700	▲25,400	▲700	▲25,400	▲2,000	▲2,000
過不足	+100	+25,200	+100	+25,200	+3,000	+3,000
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		
共通担保(全店)			▲8,800	+9,400		
CP等買入	▲400		▲100	+4,000		
国債補完供給	+27,400	▲26,300	+26,300			
当座預金増減	+800	+6,600	+800	+6,600	+3,000	+3,000
当座預金残高	5,415,200	5,421,800	5,415,200	5,421,800	5,418,800	5,418,800
準備預金残高	4,741,800		4,741,800			
積み終了先	4,741,700		4,741,700			
超過準備	4,741,700		4,741,700			
非準備先残高	673,400		673,400			
準備預金進捗率	99.9%		99.9%			
平均	90.3%		90.3%			
乖離率	9.6%		9.6%			

9月12日のオペ結果

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国庫短期証券買入(9/13~)	1,000	3,332	1,001	0.010	0.017	5.2
国債買入(固定利回り方式)(9/13~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(9/14~9/21)						
7	7	5.590	5.590			
国債補完供給(9/12~9/13)	26,463	26,463	▲0.350	▲0.352		
193	193	▲0.350	▲0.350			
共通担保(全店)(9/13~9/27)	9,362	9,362				
米ドル資金供給用担保国債供給(9/13~9/22)	5,000	6	6	▲0.100	▲0.100	

マネタリーベース	所要
9月11日時点	6,670,200
今積期の所要準備額	4,018,100
9月13日以降の残り所要	
積数	200
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(第1183回)
9月21日	3ヶ月
9月29日	3ヶ月
9月14日	20年
9月26日	40年
9月28日	2年
10月3日	10年

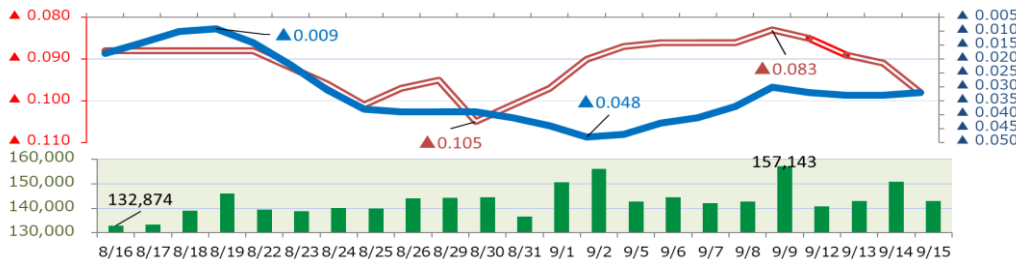
今月の国債買入オペ予定

オベ種類	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
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	4	8	20	27
5年超10年以下	4,500~9,000	6,750	8	13	20	27
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	4	8	20	27
25年超	500~3,500	1,000	4	13	27	
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