



### 短期市場の推移

	[億円] [%]			
	9月7日	9月8日	9月11日	9月12日
加重平均金利	▲0.072	▲0.066	▲0.060	▲0.048
東京レポレート(TN)	▲0.106	▲0.098	▲0.095	▲0.095
無コール残	156,664	140,845	148,998	147,578
ON	74,066	65,567	74,820	75,170
その他	82,598	75,278	74,178	72,408
有コール残	28,998	31,062	28,994	29,956

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	▲0.016	▲0.092
T/N	-	-	-	▲0.091
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.055	0.001	▲0.015	▲0.114
2W	▲0.055	▲0.010	▲0.033	▲0.122
3W	-	-	-	▲0.149
1M	-	-	-	▲0.149
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.025	▲0.136
6M	-	-	-	▲0.124
1Y	-	-	-	▲0.085

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14日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	13:30	7月の鉱工業生産確報(経産省)		(欧) ECB理事会 ラガルドECB総裁の会見
	-		-	
	-		-	

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.020%の合出から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.005%の水準で取引された。8月積み期終盤のビッドサイドの調達ニーズの強まりにより、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.032%の▲0.016%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.010	- ~ -	▲0.020 ~ ▲0.005

### 翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達意欲は強く、出合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13日	9月14日	9月13日	9月14日	9月13日	9月14日
券	+100	▲300			+0	
財政	▲25,600	+3,200			▲9,000	
過不足	▲25,500	+2,900			▲9,000	
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				+13,400		
共通担保(全店)	▲8,800	+9,400				
CP等買入	▲100	+4,000	▲500			
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+26,300	▲27,000	+27,000			
貸出増加支援					▲13,000	+35,400
当座預金増減	▲20,700	+42,700			+13,400	
当座預金残高	5,394,500	5,437,200			5,450,600	
準備預金残高	4,778,800					
積み終了先	4,778,700					
超過準備	4,778,700					
非準備先残高	615,700					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	93.5%					
乖離率	6.4%					

### 9月13日のオペ結果

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)(9/14~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(9/14~)						
~1年	1,500	5,874	1,504	0.000	0.009	26.3
1~3年	4,250	5,244	4,251	▲0.010	▲0.004	4.9
5~10年	6,750	17,020	6,763	▲0.013	▲0.011	85.6
25年~	1,000	1,435	1,001	▲0.036	▲0.022	85.7
国債補完供給(9/13~9/14)						
	27,441	27,441	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マナターベース	[億円]
9月12日時点	6,670,200

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,018,100
9月14日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

### 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

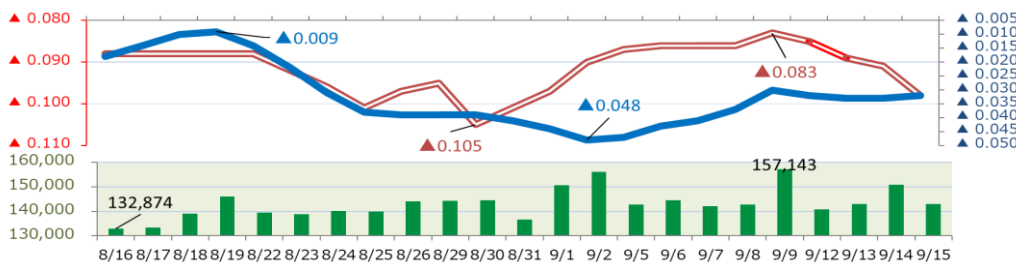
### 今月の国債買入オペ予定

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13日	0
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	4 8 13 20	9月13日	1
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13日	2
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13日	1
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