



短期市場の推移

	9月8日	9月11日	9月12日	9月13日
加重平均金利	▲0.066	▲0.060	▲0.048	▲0.016
東京レポレート(TN)	▲0.098	▲0.095	▲0.095	▲0.091
無コール残	140,845	148,998	147,578	141,859
ON	65,567	74,820	75,170	69,401
その他	75,278	74,178	72,408	72,458
有コール残	31,062	28,994	29,956	29,786

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	▲0.012	▲0.091
T/N	-	-	▲0.020	▲0.105
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.055	▲0.030	▲0.047	▲0.118
2W	▲0.035	0.010	▲0.022	▲0.126
3W	-	-	-	▲0.152
1M	-	-	-	▲0.150
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.135
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15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▲0.010%の合出から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.003%の水準で取引された。昨日対比でビットサイドの調達ニーズが一層強まったこともあり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.004%の▲0.012%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.007 ~ ▲0.007	- ~ -	▲0.015 ~ ▲0.003

翌営業日のマーケット

新積み期にかかる4日積みであり一部ビットサイドの様子見姿勢も想定され、出合水準は本日対比低下を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月14日	9月15日	9月14日	9月15日	9月14日	9月15日
券	▲300			+300		▲1,000
財政	+5,500			▲4,600		+13,000
過不足		+5,200		▲4,300		+12,000
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		+13,400				
共通担保(全店)				+10,000		
CP等買入	▲500			▲700		
社債等買入	▲100			▲900		
国債補充供給	+27,000	▲26,500	+26,500			
貸出増加支援			▲16,800	+35,400		
当座預金増減		+18,500		+49,200		+12,000
当座預金残高		5,413,000		5,462,200		5,474,200
準備預金残高		4,784,500				
積み終了先		4,784,500				
超過準備		4,784,500				
非準備先残高		628,500				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		96.8%				
乖離率		3.2%				

9月14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)(9/15~)	5~10年	0	0
5~10年	0	0	
5~10年	0	0	

国債補充供給(9/14~9/15)	26,879	26,879	▲0.350	▲0.351
	0	0		
共通担保(全店)(9/15~2028/9/15)	10,000	37,318	10,005	0.170 0.208 6.3

マネタリーベース	9月13日時点	6,649,400
----------	---------	-----------

所要	今積期の所要準備額	4,018,100
	9月15日以降の残り所要	
	積数	0
	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

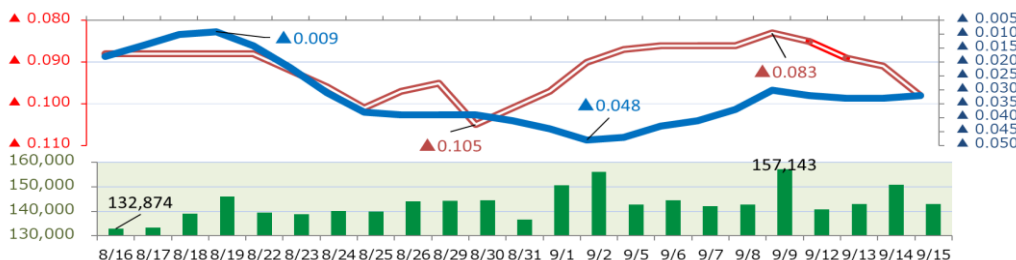
今月の国債買入オペ予定

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