



## デイリーシグナル

2023年9月19日(火)

### 短期市場の推移

	9月12日	9月13日	9月14日	9月15日
加重平均金利	▲0.048	▲0.016	▲0.012	▲0.043
東京レポレート(TN)	▲0.095	▲0.091	▲0.105	▲0.121
無コール残	147,578	141,859	137,037	147,631
ON	75,170	69,401	66,919	78,403
その他	72,408	72,458	70,118	69,228
有コール残	29,956	29,786	28,691	29,839

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	▲0.059	▲0.130
T/N	-	-	-	▲0.151
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.163
2W	-	-	▲0.060	▲0.176
3W	-	-	-	▲0.168
1M	0.005	0.020	0.013	▲0.165
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.025	▲0.139
6M	-	-	-	▲0.125
1Y	-	-	-	▲0.084

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20日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) FOMC	-
-	-	-	-
-	-	-	-

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.060%の出合から始まり、その後は主に▲0.065%~▲0.055%の水準で取引された。ビッドサイドの様子見姿勢は前営業日から継続されており、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.016%の▲0.059%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.065 ~ ▲0.050

### 翌営業日のマーケット

本日対比主だった動態変化は見られず出合水準は横ばい圏~若干の低下を想定。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月19日		9月20日		9月21日	
券	+500		+300		▲1,000	
財政	+10,100		+42,800		▲1,000	
過不足	+10,600		+43,100		▲2,000	
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
CP等買入	▲300		▲100			
社債等買入	▲1,200		▲500			+1,000
国債補充供給	+27,000	▲32,000	+32,000			
当座預金増減	+4,100		+74,500		▲1,000	
当座預金残高	5,439,400		5,513,900		5,512,900	
準備預金残高	4,742,700		主な需給要因			
積み終了先	4,733,500		流動性供給			
超過準備	4,730,700		国庫短期証券発行・償還(1Y)			
非準備先残高	696,700		国債大量償還			
準備預金進捗率	98.7%					
平均	13.3%					
乖離率	85.3%					

### 9月19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)(9/20~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(9/21~9/28)						
	0	0	5,590	5,590		
国債補充供給(9/19~9/20)						
	32,381	32,381	▲0.350	▲0.352		
	2	2	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース	所要
9月15日時点	6,690,200
今積期の所要準備額	3,882,600
9月20日以降の残り所要	
積数	51,900
平均	2,000

### 国庫短期証券入札予定

9月21日	3ヶ月(第1184回)
9月29日	3ヶ月
10月5日	6ヶ月
10月6日	3ヶ月

### 国債入札予定

9月26日	40年
9月28日	2年
10月3日	10年
10月5日	30年

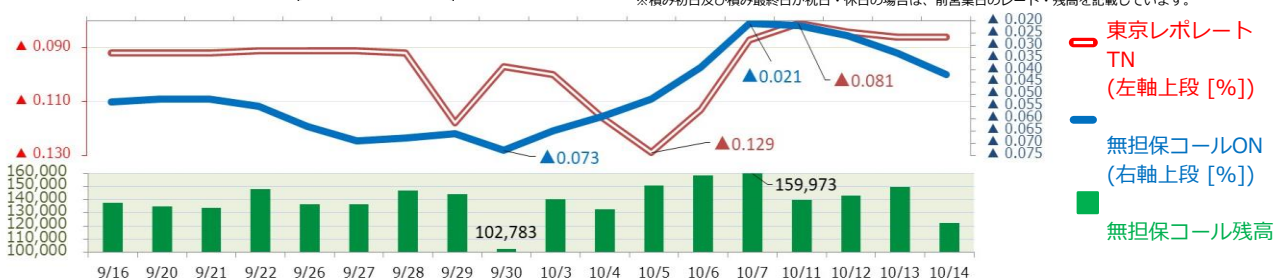
### 今月の国債買入オペ予定

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
物価運動債	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9月積み期 [9月16日~10月14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。



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