



短期市場の推移

	9月13日	9月14日	9月15日	9月19日
加重平均金利	▲0.016	▲0.012	▲0.043	▲0.059
東京レボレート(TN)	▲0.091	▲0.105	▲0.121	▲0.151
無コール残	141,859	137,037	147,631	173,435
ON	69,401	66,919	78,403	100,727
その他	72,458	70,118	69,228	72,708
有コール残	29,786	28,691	29,839	29,264

加重平均金利、コール残高は日銀、東京レボ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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.087	0.001	▲0.056	▲0.128
T/N	-	-	-	▲0.174
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.059	▲0.020	▲0.052	▲0.179
2W	-	-	-	▲0.198
3W	-	-	-	▲0.178
1M	-	-	-	▲0.170
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.140
6M	-	-	-	▲0.126
1Y	-	-	-	▲0.081

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

9月21日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
日銀金融政策決定会合 (22日まで)		(米) 新規失業保険申請件数	
-	-	-	-
-	-	-	-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.055%の合出から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.045%の水準で取引された。昨日の様子見姿勢から一転し、ビットサイドが強い調達意欲を見せたため、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.003%の▲0.056%となった。

[%]		
都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.060 ~ ▲0.045

翌営業日のマーケット

引き続きビットサイドの調達意欲は強く、合出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20日	9月21日	9月21日	9月22日	9月22日	9月22日
券	+400	▲400	▲400	+2,000		
財政	+40,000	▲2,800	▲2,800	▲12,000		
過不足	+40,400	▲3,200	▲3,200	▲10,000		
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				+17,600		
CP等買入	▲100		▲200			
社債等買入	▲500		▲100	+1,000		
国債補充供給	+32,000	▲39,300	+39,300			
当座預金増減	+32,500	+55,400	+55,400	▲10,000		
当座預金残高	5,471,900	5,527,300	5,527,300	5,517,300		
準備預金残高	4,775,000				主な需給要因	
積み終了先	4,767,400				流動性供給	
超過準備	4,766,300					
非準備先残高	696,900					
準備預金進捗率	98.9%					
平均	16.7%					
乖離率	82.2%					

9月20日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(9/21~)	1,000	6,139	1,001	0.000	0.006	74.0
国債買入(固定利回り方式)(9/21~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(9/21~)						
1~3年	4,250	6,709	4,251	▲0.013	▲0.008	84.1
3~5年	4,500	12,404	4,506	0.001	0.004	58.2
5~10年	6,750	16,221	6,756	0.000	0.003	0.3
10~25年	2,000	5,481	2,005	0.006	0.009	21.0
国債補充供給(9/20~9/21)						
	39,469	39,469	▲0.450	▲0.452		
	320	320	▲0.450	▲0.450		

マネタリーベース (億円)
 9月19日時点 6,693,800

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,882,600
9月21日以降の残り所要	
積数	43,100
平均	1,700

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

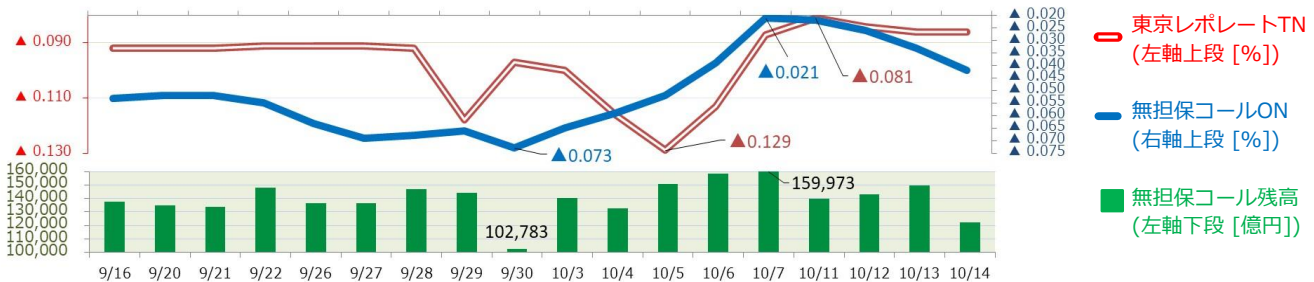
今月の国債買入オペ予定

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20日	0
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	4 8 20 27	9月20日	1
5年超10年以下	4,500~9,000	6,750	8 13 20 27	9月20日	1
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	4 8 20 27	9月20日	1
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