



短期市場の推移

	9月19日	9月20日	9月21日	9月22日
加重平均金利	▲0.059	▲0.056	▲0.049	▲0.039
東京レポレート(TN)	▲0.151	▲0.174	▲0.181	▲0.289
無コール残	173,435	173,732	182,306	188,552
ON	100,727	94,754	99,483	104,799
その他	72,708	78,978	82,823	83,753
有コール残	29,264	27,915	27,631	25,941

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	▲0.042	▲0.130
T/N	-	-	-	▲0.181
S/N	-	-	-	-
1W	0.002	0.070	0.032	▲0.275
2W	▲0.040	0.020	▲0.036	▲0.234
3W	-	-	-	▲0.215
1M	-	-	0.100	▲0.199
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.149
6M	-	-	-	▲0.121
1Y	-	-	-	▲0.082

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26日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	23:00 米 消費者信頼感指数(9月)	105.5
-	-	-	-
-	-	-	-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.035%の合出から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.030%の水準で取引された。先週末と比べビッドサイドの調達意欲は減退し、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.003%の▲0.042%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.050 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

オファービッド共に大きな動向変化はなく、出合いの水準は本日対比横ばいと想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月25日		9月26日		9月27日	
券	+600		▲100		+0	
財政	+11,400		+4,200		▲22,000	
過不足	+12,000		+4,100		▲22,000	
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
共通担保(全店)					▲9,400	
CP等買入	▲200		▲400			
社債等買入	▲200					
国債補完供給	+37,400	▲36,500	+36,500			
当座預金増減	+12,500		+40,200		▲31,400	
当座預金残高	5,494,100		5,534,300		5,502,900	
準備預金残高	4,807,400		主な需給要因			
積み終了先	4,805,200		国債発行(40年)			
超過準備	4,805,100		各種財政資金の貸し付け回収			
非準備先残高	686,700					
準備預金進捗率	99.3%					
平均	33.3%					
乖離率	66.0%					

9月25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)(9/26~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(9/25~9/26)						
	37,154	37,154	▲0.550	▲0.551		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
9月22日時点 6,736,000

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,882,600
9月26日以降の残り所要	
積数	26,000
平均	1,300

国債短期証券入札予定

9月29日	3ヶ月(第1185回)
10月5日	6ヶ月
10月6日	3ヶ月
10月13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