



短期市場の推移 [億円] [%]

	9月20日	9月21日	9月22日	9月25日
加重平均金利	▲0.056	▲0.049	▲0.039	▲0.042
東京レボレート(TN)	▲0.174	▲0.181	▲0.289	▲0.181
無コール残	173,732	182,306	188,552	180,404
ON	94,754	99,483	104,799	100,201
その他	78,978	82,823	83,753	80,203
有コール残	27,915	27,631	25,941	27,845

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	▲0.051	▲0.185
T/N	-	-	-	▲0.251
S/N	-	-	-	-
1W	0.003	0.130	0.042	▲0.326
2W	-	-	-	▲0.252
3W	-	-	-	▲0.224
1M	-	-	-	▲0.203
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.152
6M	-	-	-	▲0.120
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27日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	金融政策決定会合議事要旨 (7月27,28日開催分)		21:30	(米) 8月耐久財受注	
	-			-	
	-			-	

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。前営業日のレート低下を受けベッドサイドの慎重姿勢の高まりもあり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.009%の▲0.051%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.065 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

取り手の様子見姿勢はより顕著に見られ、出合水準は本日対比低下を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月26日	9月27日	9月27日	9月28日	9月28日	9月29日
券	▲200		+200	▲2,000		▲1,000
財政	+3,900		▲17,600	▲1,000		
過不足		+3,700		▲17,400		▲3,000
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		
共通担保(全店)			▲9,400	+8,500		
CP等買入	▲400		▲300			
国債補完供給	+36,500	▲27,400	+27,400			
当座預金増減		+12,400		+9,800		▲3,000
当座預金残高		5,506,500		5,516,300		5,513,300
準備預金残高		4,800,900				
積み終了先		4,798,800				
超過準備		4,798,800				
非準備先残高		705,600				
準備預金進捗率		99.4%				
平均		36.7%				
乖離率		62.7%				

9月26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(9/27~)	1,000	4,781	1,000	0.000	0.000	88.8
国債買入(固定利回り方式)(9/27~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(9/28~10/5)	0	0	5.580	5.580		
CP等買入(9/29~)	4,000	6,779	3,994	0.000	0.016	81.3
国債補完供給(9/26~9/27)	27,820	27,820	▲0.450	▲0.451		
	0	0				
共通担保(全店)(9/27~10/11)	8,510	8,510				

マナタリベース [億円]	所要 [億円]
9月25日時点 6,747,900	今積期の所要準備額 3,882,600
	9月27日以降の残り所要
	積数 23,900
	平均 1,300

国庫短期証券入札予定

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28日	2年
10月3日	10年
10月5日	30年
10月11日	5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