



短期市場の推移

	9月22日	9月25日	9月26日	9月27日
加重平均金利	▲0.039	▲0.042	▲0.051	▲0.064
東京レポレート(TN)	▲0.289	▲0.181	▲0.251	▲0.397
無コール残	188,552	180,404	205,074	203,706
ON	104,799	100,201	117,461	112,213
その他	83,753	80,203	87,613	91,493
有コール残	25,941	27,845	21,860	22,837

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	▲0.063	▲0.259
T/N	-	-	▲0.060	▲0.547
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.060	▲0.362
2W	▲0.057	0.001	▲0.042	▲0.263
3W	-	-	-	▲0.221
1M	▲0.022	0.040	▲0.014	▲0.197
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.030	▲0.155
6M	-	-	-	▲0.120
1Y	-	-	-	▲0.083

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29日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	8月有効求人倍率		18:00	(欧) 9月消費者物価(速報)
8:30	9月中旬の東京都区消費者物価		21:30	(米)8月個人消費支出
8:50	鉱工業生産速報			(欧) ラガルドECB総裁の講演

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.063%の合出から始まり、その後は主に▲0.070%~▲0.050%の水準で取引された。前営業日対比だった動態変化は見られず、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.063%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.070 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

翌営業日は半期末のため一部取り手が調達を控えることから、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28日		9月29日		10月2日	
券	▲400		+100		+1,000	
財政	+0		▲3,600		▲21,000	
過不足	▲400		▲3,500		▲20,000	
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	+14,900					
CP等買入	▲1,300		▲6,500	+4,000		
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+28,100	▲33,500	+33,500			
当座預金増減	+7,700		+27,500		▲20,000	
当座預金残高	5,493,700		5,521,200		5,501,200	
準備預金残高	4,796,200		主な需給要因			
積み終了先	4,794,800		国債発行・償還(2年)			
超過準備	4,794,300					
非準備先残高	697,500					
準備預金進捗率	99.5%					
平均	43.3%					
乖離率	56.1%					

9月28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)(9/29~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(9/28~9/29)						
	34,050	34,050	▲0.650	▲0.651		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

9月27日時点 6,739,900

所要

今積期の所要準備額	3,882,600
9月29日以降の残り所要	
積数	20,400
平均	1,200

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(第1186回)
10月6日	3ヶ月
10月13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27日	0
5年超10年以下	4,500~9,000	6,750	8 13 20 27	9月27日	0
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	4 8 20 27	9月27日	0
25年超	500~3,500	1,000	4 13 27	9月27日	0
物価連動債	600	600	月1回	9月27日	0
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