



短期市場の推移

	9月25日	9月26日	9月27日	9月28日
加重平均金利	▲0.042	▲0.051	▲0.064	▲0.063
東京レポレート(TN)	▲0.181	▲0.251	▲0.397	▲0.547
無コール残	180,404	205,074	203,706	215,795
ON	100,201	117,461	112,213	125,522
その他	80,203	87,613	91,493	90,273
有コール残	27,845	21,860	22,837	21,895

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	▲0.062	▲0.551
T/N	-	-	-	▲0.135
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	▲0.037	▲0.041	▲0.139
2W	-	-	▲0.040	▲0.156
3W	-	-	-	▲0.159
1M	▲0.010	0.030	0.014	▲0.155
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.182
6M	-	-	-	▲0.124
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

10月2日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	日銀短観		23:00 米 ISM製造業指数(9月)	47.8
8:50	金融政策決定会合における主な意見(9月21~22日)		米 製造業PMI(9月)	

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.065%の出合から始まり、その後は主に▲0.075%~▲0.050%の水準で取引された。半期末のため運用と調達を見送る先があり、出合水準は横ばいで推移し、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の▲0.062%となった。前営業日の無担保コール市場残高は215,795億円と、2001年1月の数値公表以降最大の残高を記録した。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.075 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

翌営業日は調達を控えていた取り手も、再開予定のため出合水準は本日対比上昇を想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月29日		10月2日		10月3日	
券	+100		+400		+0	
財政	▲4,400		▲22,900		+0	
過不足	▲4,300		▲22,500		+0	
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				+3,000		
CP等買入	▲6,500	+4,000	▲200			
国債補完供給	+33,500	▲48,400	+48,400			
当座預金増減	▲21,700		+28,700		+0	
当座預金残高	5,472,000		5,500,700		5,500,700	
準備預金残高	4,799,300		主な需給要因			
積み終了先	4,798,600		国債発行・償還(2年)			
超過準備	4,794,000					
非準備先残高	672,700					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	53.3%					
乖離率	46.6%					

9月29日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(固定利回り方式)(10/2~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(9/29~10/2)						
	48,608	48,608	▲0.750	▲0.751		
	732	732	▲0.750	▲0.750		
国債買入(10/2~)						
5~10年	3,000	9,812	3,007	0.006	0.008	32.5

マネタリーベース	所要
9月28日時点	6,747,900
今積期の所要準備額	3,882,600
10月2日以降の残り所要	
積数	4,400
平均	300

国債短期証券入札予定

10月5日	6ヶ月(第1186回)
10月6日	3ヶ月(第1187回)
10月13日	3ヶ月
10月19日	1年

国債入札予定

10月3日	10年
10月5日	30年
10月11日	5年
10月17日	20年

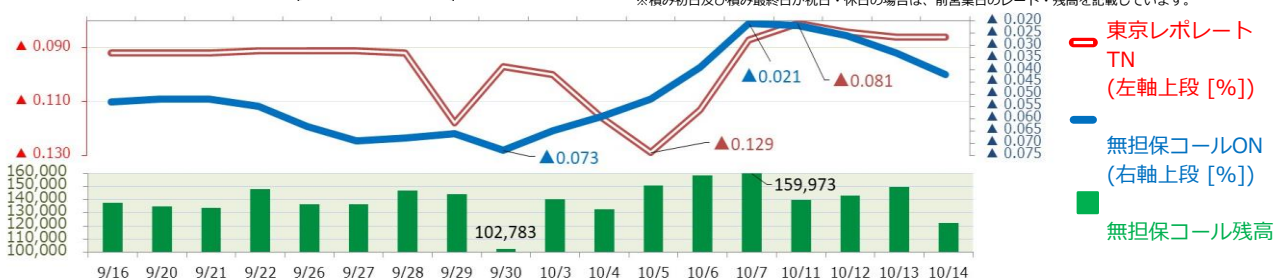
来月の国債買入オペ予定

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	1
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	4 10 16 23	9月20日	4
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	4 16 23 27	9月27日	4
5年超10年以下	4,500~9,000	3,000	10 16 23 27	9月29日	4
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	4 10 23 27	9月27日	4
25年超	500~3,500	1,000	10 16 27	9月27日	3
物価連動債	600	600	月1回	9月27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