



短期市場の推移

	9月5日	9月6日	9月9日	9月10日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.228
東京レポレート(TN)	0.239	0.241	0.236	0.230
無コール残	76,560	75,464	75,562	80,226
ON	33,613	33,417	32,375	33,909
その他	42,947	42,047	43,187	46,317
有コール残	40,247	41,304	39,660	40,799

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 [%]

9月12日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:00	田村日銀審議委員のあいさつ (岡山県)		(米) 生産者物価 (8月)	
	-		-	
	-		-	

本日の市場

	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	0.215	0.229	0.227	0.251
T/N	-	-	-	0.235
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.228	0.203
2W	0.300	0.320	0.314	0.201
3W	-	-	-	0.197
1M	0.320	0.350	0.337	0.198
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.370	0.205
6M	-	-	-	0.251
1Y	-	-	-	0.317

本日の市況

無担保コールON物は0.228%の出合から始まり、その後は主に0.225%~0.228%を中心に取引された。ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の0.227%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	0.225 ~ 0.228

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であり、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

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

資金需給

	[億円]				
	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	9月11日		9月12日		9月13日
券	+0		▲300		+0
財政	▲30,600		+4,400		▲4,000
過不足	▲30,600		+4,100		▲4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入				+12,200	
CP等買入	▲200				
社債等買入			▲100		
国債補完供給	+15,200	▲15,100	+15,100		
貸出増加支援					▲132,300
					+121,500
当座預金増減	▲30,700		+31,300		▲14,800
当座預金残高	5,412,100		5,443,400		5,428,600
準備預金残高	4,839,700		主な需給要因		
積み終了先	4,839,700		源泉税揚げ		国債発行(20年)
超過準備	4,839,700				
非準備先残高	572,400				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	87.1%				
乖離率	12.8%				

9月11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(9/12~)						
1~3年	3,500	9,522	3,505	▲0.019	▲0.015	6.3
3~5年	3,750	6,284	3,752	▲0.030	▲0.025	2.8
5~10年	4,000	9,215	4,008	▲0.033	▲0.032	87.7
25年~	750	2,183	753	▲0.012	▲0.010	75.5
国債補完供給(9/11~9/12)						
	15,305	15,305	▲0.050	▲0.050		
	100	100	▲0.050	▲0.050		

マネタリーベース [億円]	所要 [億円]
9月10日時点 6,684,000	今積期の所要準備額 4,071,500
	9月12日以降の残り所要
	積数 100
	平均 0

国債短期証券入札予定

9月13日	3ヶ月(第1256回)
9月18日	1年(第1257回)
9月19日	3ヶ月
9月27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	4				9月4日	0
1年超3年以下	3500	3,500	4	11	18	25	9月11日	2
3年超5年以下	3750	3,750	4	11	18	25	9月11日	2
5年超10年以下	4000	4,000	6	11	18	25	9月11日	2
10年超25年以下	1500	1,500	6	18	25		9月6日	2
25年超	750	750	6	11			9月11日	0
物価連動債	600	600	25				8月28日	1
変動利付債	-	300					2023/4/14	-

国債入札予定

9月12日	20年
9月26日	40年
9月30日	2年
10月3日	10年

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