



短期市場の推移 [徳円] [%]

	8月24日	8月25日	8月28日	8月29日
加重平均金利	▲0.063	▲0.061	▲0.060	▲0.055
東京レポレート(TN)	▲0.149	▲0.129	▲0.163	▲0.161
無コール残	168,889	168,803	173,064	174,710
ON	86,536	85,650	89,881	95,527
その他	82,353	83,153	83,183	79,183
有コール残	26,914	27,443	24,886	26,866

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	▲0.052	▲0.164
T/N	-	-	-	▲0.204
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	▲0.058	▲0.059	▲0.179
2W	▲0.055	▲0.042	▲0.051	▲0.167
3W	-	-	-	▲0.163
1M	▲0.030	▲0.009	▲0.021	▲0.163
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.144
6M	-	-	-	▲0.124
1Y	-	-	-	▲0.092

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

8月31日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	7月鉱工業生産指数		21:30	(米) 7月個人消費支出
	-			-
	-			-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.055%の合出から始まり、その後は主に▲0.060%~▲0.050%の水準で取引された。前営業日に引き続きビットサイドの調達意欲の強まりが見られ、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.003%の▲0.052%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲ 0.060 ~ ▲ 0.060	▲ 0.060 ~ ▲ 0.050

翌営業日のマーケット

オファービッドに主だった動態変化は見られず、出合水準は横ばい圏を想定。

資金需給 [徳円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	8月30日		8月31日		9月1日
券	+0		+0		▲1,000
財政	▲1,000		+1,700		▲12,400
過不足	▲1,000		+1,700		▲13,400
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+1,000			
国債買入				+14,800	
共通担保(全店)	▲7,300	+8,800			
CP等買入			▲2,000	+4,000	
社債等買入	▲100		▲300		
国債補完供給	+28,900	▲28,400	+28,400		
成長基盤強化支援					▲1,900
当座預金増減	+1,900		+46,600		▲15,300
当座預金残高	5,468,700		5,515,300		5,500,000
準備預金残高	4,751,700		主な需給要因		
積み終了先	4,749,800		国債発行・償還(2年)		
超過準備	4,749,800				
非準備先残高	717,000				
準備預金進捗率	99.7%				
平均	48.4%				
乖離率	51.3%				

8月30日のオペ結果 [%][徳円] ※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)(8/31~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(8/31~)						
3~5年	4,500	8,995	4,505	0.005	0.006	80.5
5~10年	6,750	12,650	6,758	0.000	0.003	96.4
10~25年	2,000	3,244	2,004	0.010	0.011	90.6
25年~	1,000	1,899	1,003	0.011	0.013	58.3
物価連動	600	2,121	600	▲0.070	▲0.293	39.0
国債補完供給(8/30~8/31)						
	28,679	28,679	▲0.450	▲0.452		
	0	0				

マネタリーベース [徳円]	所要 [徳円]
8月29日時点	6,726,200
今積期の所要準備額	4,009,600
8月31日以降の残り所要	
積数	11,000
平均	700

国庫短期証券入札予定

9月1日	3ヶ月(第1179回)
9月7日	6ヶ月
9月8日	3ヶ月
9月15日	3ヶ月

国債入札予定

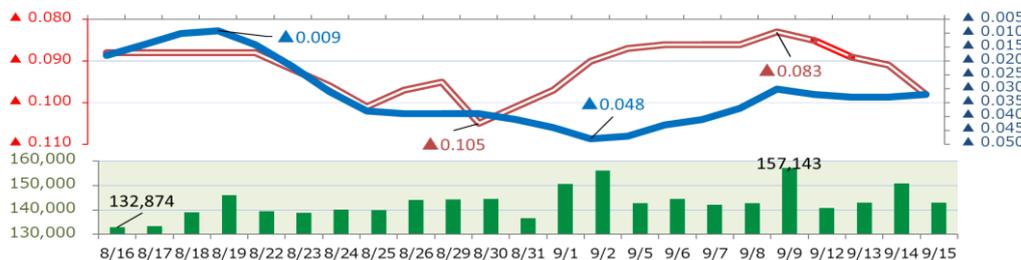
9月5日	10年
9月7日	30年
9月12日	5年
9月14日	20年

今月の国債買入オペ予定 [徳円]

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	8月16日	0
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	2 9 16 23	8月23日	0
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	2 9 23 30	8月30日	0
5年超10年以下	4,500~9,000	6,750	2 9 16 30	8月30日	0
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	2 9 23 30	8月30日	0
25年超	500~3,500	1,000	2 16 30	8月30日	0
物価連動債	600	600	月1回	8月30日	0
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	4月14日	-

1年前の市場推移 ○2022年8月積み期 [8月16日~9月15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。



東京レポレート
 TN
 (左軸上段 [%])
 無担保コールON
 (右軸上段 [%])
 無担保コール残高

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