



短期市場の推移

	8月25日	8月28日	8月29日	8月30日
加重平均金利	▲0.061	▲0.060	▲0.055	▲0.052
東京レボレート(TN)	▲0.129	▲0.163	▲0.161	▲0.204
無コール残	168,803	173,064	174,710	183,529
ON	85,650	89,881	95,527	106,631
その他	83,153	83,183	79,183	76,898
有コール残	27,443	24,886	26,866	24,766

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	▲0.056	▲0.161
T/N	-	-	-	▲0.164
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	▲0.013	▲0.040	▲0.162
2W	▲0.055	0.000	▲0.045	▲0.158
3W	▲0.053	0.001	▲0.035	▲0.158
1M	▲0.060	▲0.030	▲0.045	▲0.162
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.142
6M	-	-	-	▲0.123
1Y	-	-	-	▲0.092

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1日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 (米) 8月の雇用統計	非農業部門雇用者数 前月比17万増
-	-	-	-
-	-	-	-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.055%の出合から始まり、その後は主に▲0.070%~▲0.050%の水準で取引された。月末のため調達を見送る先が一部あり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.004%の▲0.056%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.070	- ~ -	▲0.060 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

週末3日積みのため地銀業態の積極的な調達が想定され、出合水準は本日対比上昇と想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	8月31日	9月1日	9月1日	9月4日	9月4日
券	+0	+600	+0	+0	+0
財政	▲300	▲34,700	▲25,400	▲25,400	▲25,400
過不足	▲300	▲34,100	▲25,400	▲25,400	▲25,400
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		+14,800			
CP等買入	▲2,000	+4,000	▲100		
社債等買入	▲300		▲100		
国債補完供給	+28,400	▲28,400	+28,400		
成長基盤強化支援			▲3,700		
当座預金増減	+16,200	▲9,600	▲25,400		
当座預金残高	5,484,900	5,475,300	5,449,900		
準備預金残高	4,764,600	主な需給要因			
積み終了先	4,763,100	国債発行・償還(2年)	法人税・消費税・年金保険揚げ		
超過準備	4,762,900		普通交付税交付金		
非準備先残高	720,300				
準備預金進捗率	99.8%				
平均	51.6%				
乖離率	48.2%				

8月31日のオペ結果

オベ種類 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)(9/1~)	
5~10年	0 0
5~10年	0 0
国債補完供給(8/31~9/1)	
28,605 28,605 ▲0.450 ▲0.450	
117 117 ▲0.450 ▲0.450	

マネタリーベース (億円)
8月30日時点 6,728,100

所要	(億円)
今積期の所要準備額	4,009,600
9月1日以降の残り所要	
積数	9,300
平均	600

国債短期証券入札予定

9月1日	3ヶ月(第1179回)
9月7日	6ヶ月(第1180回)
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

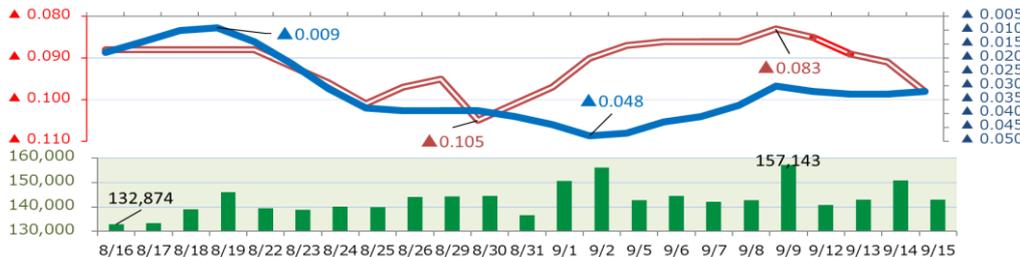
来月の国債買入オペ予定

オベ種類	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	1
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	4 8 13 20	8月23日	4
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	4 8 20 27	8月30日	4
5年超10年以下	4,500~9,000	6,750	8 13 20 27	8月30日	4
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	4 8 20 27	8月30日	4
25年超	500~3,500	1,000	4 13 27	8月30日	3
物価連動債	600	600	月1回	8月30日	1
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