



短期市場の推移 [億円] [%]

	8月28日	8月29日	8月30日	8月31日
加重平均金利	▲0.060	▲0.055	▲0.052	▲0.056
東京レポレート(TN)	▲0.163	▲0.161	▲0.204	▲0.164
無コール残	173,064	174,710	183,529	162,395
ON	89,881	95,527	106,631	92,427
その他	83,183	79,183	76,898	69,968
有コール残	24,886	26,866	24,766	27,329

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	▲0.060	▲0.148
T/N	-	-	-	▲0.152
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.033	▲0.155
2W	▲0.070	0.030	▲0.035	▲0.157
3W	-	-	0.001	▲0.158
1M	-	-	-	▲0.165
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.143
6M	-	-	-	▲0.123
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

9月4日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想

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▲0.075%~▲0.050%の水準で取引された。オファーサイドが放出を積極化させたことで、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.004%の▲0.060%となった。

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

翌営業日のマーケット

オファービッドの動向に大きな変化はなく、合出水準は本日対比横ばいと想定。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月1日	9月4日	9月1日	9月4日	9月5日	9月5日
券	+600		+1,000		+1,000	
財政	▲36,500		▲23,200			
過不足	▲35,900		▲22,200		+1,000	
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
CP等買入	▲100		▲500			
社債等買入	▲100		▲100			
国債補完供給	+28,400	▲32,900	+32,900			
成長基盤強化支援	▲3,700					
当座預金増減	▲44,300		+10,100		+1,000	
当座預金残高	5,440,600		5,450,700		5,451,700	
準備預金残高	4,730,600					
積み終了先	4,729,500		法人税・消費税・年金保険揚げ			
超過準備	4,729,400		普通交付税交付金			
非準備先残高	710,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	61.3%					
乖離率	38.6%					

9月1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)(9/4~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(9/1~9/4)						
	32,431	32,431	▲0.450	▲0.451		
	851	851	▲0.450	▲0.450		

マネタリーベース [億円]
8月31日時点 6,744,200

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,009,600
9月4日以降の残り所要	
積数	5,700
平均	500

国債短期証券入札予定

9月7日	6ヶ月(第1180回)
9月8日	3ヶ月(第1181回)
9月15日	3ヶ月
9月19日	1年

国債入札予定

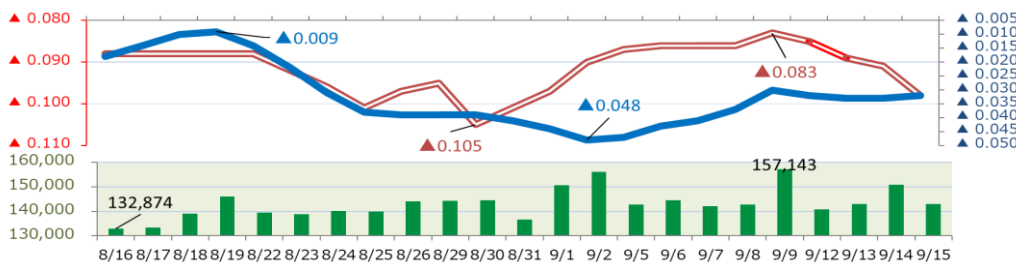
9月5日	10年
9月7日	30年
9月12日	5年
9月14日	20年

今月の国債買入オペ予定

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	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