



	8月29日	8月30日	8月31日	9月1日
加重平均金利	▲0.055	▲0.052	▲0.056	▲0.060
東京レポレート(TN)	▲0.161	▲0.204	▲0.164	▲0.152
無コール残	174,710	183,529	162,395	175,041
ON	95,527	106,631	92,427	104,703
その他	79,183	76,898	69,968	70,338
有コール残	26,866	24,766	27,329	24,613

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 [%]

	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.087	0.001	▲0.069	▲0.107
T/N	-	-	▲0.060	▲0.114
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.038	▲0.135
2W	▲0.068	0.030	▲0.049	▲0.137
3W	-	-	0.001	▲0.142
1M	0.005	0.150	0.027	▲0.160
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.141
6M	-	-	-	▲0.124
1Y	-	-	-	▲0.093

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5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▲0.060%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。三日積み要因の剥落により、ビッドサイドが調達に慎重な姿勢を見せる中、オファーサイドの放出ニーズは引き続き強く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.009%の▲0.069%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圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月4日		9月5日		9月6日	
券	+1,000		+600		+1,000	
財政	▲24,400		▲300		▲27,000	
過不足	▲23,400		+300		▲26,000	
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
国債買入				+11,400		
CP等買入	▲500		▲300			
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+32,900	▲35,400	+35,400			
当座預金増減	▲26,500		+46,800		▲26,000	
当座預金残高	5,414,100		5,460,900		5,434,900	
準備預金残高	4,723,300		主な需給要因			
積み終了先	4,721,700		国債発行(10年)			
超過準備	4,721,700					
非準備先残高	690,800					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	64.5%					
乖離率	35.4%					

9月4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)(9/5~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(9/5~)						
1~3年	4,250	6,725	4,250	▲0.002	0.000	72.4
3~5年	4,500	7,524	4,501	0.002	0.010	4.3
10~25年	2,000	4,483	2,004	0.025	0.027	80.3
25年~	1,000	1,458	1,001	0.020	0.026	57.5
国債補完供給(9/4~9/5)						
	35,762	35,762	▲0.450	▲0.450		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

9月1日時点 6,699,300

所要

	今積期の所要準備額	9月5日以降の残り所要
	4,009,600	
	積数	4,000
	平均	400

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
9月5日	10年
9月7日	30年
9月12日	5年
9月14日	20年

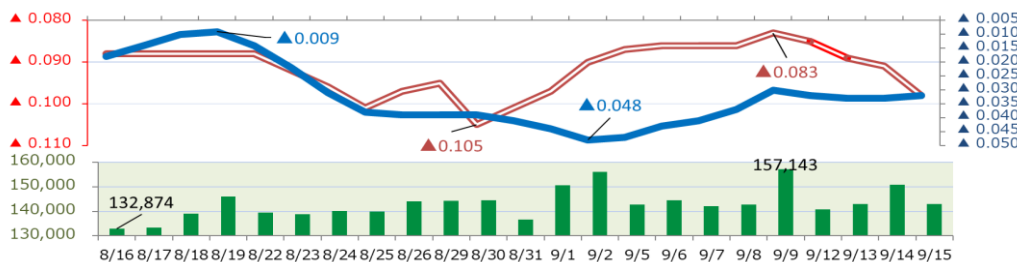
今月の国債買入オペ予定

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	9月4日	3
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	4 8 20 27	9月4日	3
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	9月4日	3
25年超	500~3,500	1,000	4 13 27	9月4日	2
物価連動債	600	600	月1回	8月30日	1
変動利付債	-	300	-	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