



### 短期市場の推移

	8月30日	8月31日	9月1日	9月4日
加重平均金利	▲0.052	▲0.056	▲0.060	▲0.069
東京レボレート(TN)	▲0.204	▲0.164	▲0.152	▲0.114
無コール残	183,529	162,395	175,041	169,172
ON	106,631	92,427	104,703	93,544
その他	76,898	69,968	70,338	75,628
有コール残	24,766	27,329	24,613	30,124

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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.087	0.001	▲0.072	▲0.107
T/N	-	-	▲0.060	▲0.115
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.073	0.000	▲0.060	▲0.129
2W	▲0.065	▲0.060	▲0.063	▲0.135
3W	-	-	-	▲0.141
1M	-	-	0.270	▲0.165
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.141
6M	-	-	-	▲0.124
1Y	-	-	-	▲0.093

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6日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米) ページブック	-
-	-	(米) ISM非製造業指数 (8月)	-
-	-	-	-

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.070%の合出から始まり、その後は主に▲0.080%~▲0.070%の水準で取引された。引き続きビッドサイドの調達意欲に弱さが見られ、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.003%の▲0.072%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.083 ~ ▲0.083	▲0.082 ~ ▲0.080	▲0.080 ~ ▲0.060

### 翌営業日のマーケット

市場動向に大きな変化はなく、出合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5日	9月6日	9月5日	9月6日	9月5日	9月6日
券	+600	+100	+600	+100	+1,000	+1,000
財政	+300	▲24,800	+300	▲24,800	+9,000	+9,000
過不足	+900	▲24,700	+900	▲24,700	+10,000	+10,000
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
国庫短期証券買入		+11,400		+1,000		
国債買入						
CP等買入	▲300					
国債補充供給	+35,400	▲35,300	+35,300			
当座預金増減	+12,100	+11,600	+12,100	+11,600	+10,000	+10,000
当座預金残高	5,426,200	5,437,800	5,426,200	5,437,800	5,447,800	5,447,800
準備預金残高	4,722,600	4,722,600	4,722,600	4,722,600	4,722,600	4,722,600
積み終了先	4,722,000	4,722,000	4,722,000	4,722,000	4,722,000	4,722,000
超過準備	4,721,500	4,721,500	4,721,500	4,721,500	4,721,500	4,721,500
非準備預金先高	703,600	703,600	703,600	703,600	703,600	703,600
準備預金進捗率	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%
平均	67.7%	67.7%	67.7%	67.7%	67.7%	67.7%
乖離率	32.2%	32.2%	32.2%	32.2%	32.2%	32.2%

### 9月5日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(9/6~)	1,000	7,774	1,001	0.008	0.008	86.0
国債買入(固定利回り方式)(9/6~)						
5~10年	0	0	0			
5~10年	0	0	0			
5~10年	0	0	0			
米ドル資金供給(9/7~9/14)						
	0	0	5.580	5.580		
国債補充供給(9/5~9/6)						
	35,715	35,715	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マナタリーベース (億円)  
 9月4日時点 6,671,800

所要	(億円)
今積期の所要準備額	4,009,600
9月6日以降の残り所要	
積数	2,900
平均	300

### 国庫短期証券入札予定

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

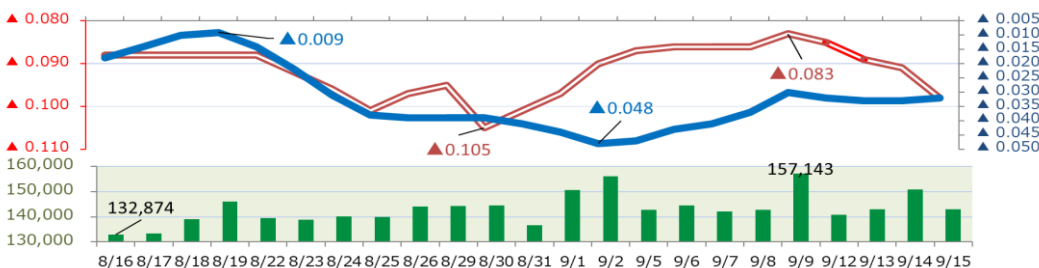
### 今月の国債買入オペ予定

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。



- 東京レボレートTN (左軸上段 [%])
- 無担保コールON (右軸上段 [%])
- 無担保コール残高 (左軸下段 [億円])

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