



## デイリーシグナル

2024年8月30日(金)

### 短期市場の推移

	[億円] [%]			
	8月26日	8月27日	8月28日	8月29日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.228
東京レポレート(TN)	0.214	0.221	0.196	0.058
無コール残	74,298	77,326	76,575	79,880
ON	33,041	35,649	33,708	36,523
その他	41,257	41,677	42,867	43,357
有コール残	39,811	38,178	38,455	37,548

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	0.218	0.229	0.227	0.173
T/N	-	-	-	0.230
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.390	0.187
2W	0.300	0.400	0.320	0.187
3W	-	-	-	0.185
1M	-	-	-	0.185
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.201
6M	-	-	-	0.252
1Y	-	-	-	0.316

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2日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-			-	
	-			-	
	-			-	

### 本日の市況

無担保コールON物は0.228%の出合から始まり、その後は主に0.225%~0.228%を中心に取引された。月末要因による取り控えによりギブン地合いとなり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の0.227%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	0.225 ~ 0.228

### 翌営業日のマーケット

ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であり、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

### 資金需給

	[億円]					
	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月30日		9月2日		9月3日	
券	+400		+600		+1,000	
財政	+2,100		▲16,900		▲7,000	
過不足	+2,500		▲16,300		▲6,000	
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	▲700	+4,000				
社債等買入	▲100		▲300			
国債補完供給	+16,100	▲16,000	+16,000			
成長基盤強化支援			▲1,500			
当座預金増減	+5,800		▲2,100		▲6,000	
当座預金残高	5,504,400		5,502,300		5,496,300	
準備預金残高	4,911,400		主な需給要因			
積み終了先	4,911,300		国庫短期証券発行償還(3M)			
超過準備	4,911,100		国債発行償還(2年)			
非準備先残高	593,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	54.8%					
乖離率	45.1%					

### 8月30日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(8/30~9/2)	16,167	16,167	▲0.150	▲0.150		
	201	201	▲0.150	▲0.150		

マネタリーベース [億円]  
8月29日時点 6,743,300

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,070,500
9月2日以降の残り所要	
積数	800
平均	100

### 国庫短期証券入札予定

9月6日	3ヶ月(第1254回)
9月9日	6ヶ月
9月13日	3ヶ月
9月18日	1年

### 国債入札予定

9月3日	10年
9月5日	30年
9月10日	5年
9月12日	20年

### 来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	4				8月2日	1
1年超3年以下	3500	3,500	4	11	18	25	8月21日	4
3年超5年以下	3750	3,750	4	11	18	25	8月28日	4
5年超10年以下	4000	4,000	6	11	18	25	8月28日	4
10年超25年以下	1500	1,500	6	18	25		8月28日	3
25年超	750	750	6	11			8月28日	2
物価連動債	600	600	25				8月28日	1
変動利付債	-	300					4月14日	-

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