



短期市場の推移

	8月29日	8月30日	9月2日	9月3日
加重平均金利	0.228	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.058	0.230	0.233	0.237
無コール残	79,880	81,634	77,956	77,759
ON	36,523	39,047	35,809	35,612
その他	43,357	42,587	42,147	42,147
有コール残	37,548	37,018	37,819	39,485

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	0.213	0.229	0.227	0.243
T/N	-	-	-	0.237
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.228	0.191
2W	-	-	0.300	0.190
3W	-	-	-	0.189
1M	0.300	0.490	0.373	0.184
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.350	0.201
6M	-	-	-	0.253
1Y	-	-	-	0.318

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
-	-	(米)ADP雇用統計(8月)	-
-	-	(米) サービス業PMI (8月・確報)	-
-	-	-	-

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。ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月4日	9月5日	9月5日	9月6日	9月6日	9月6日
券	+100		+300		▲200	
財政	▲27,800		▲800		▲4,000	
過不足	▲27,700		▲500		▲4,200	
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				+8,700		
共通担保(全店)	▲8,000	+8,000				
CP等買入			▲100			
社債等買入			▲100			
国債補充供給	+16,500	▲16,100	+16,100			
当座預金増減	▲27,300		+24,100		▲4,200	
当座預金残高	5,423,300		5,447,400		5,443,200	
準備預金残高	4,864,200		主な需給要因			
積み終了先	4,864,100		国債発行(30年)			
超過準備	4,864,100					
非準備先残高	559,100					
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

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国債買入(9/5~)	
~1年	1,500 3,236 1,501 ▲0.007 0.001 43.1
1~3年	3,500 12,142 3,501 ▲0.004 ▲0.002 9.2
3~5年	3,750 11,880 3,757 ▲0.020 ▲0.018 91.7

国債補充供給(9/4~9/5)	
	16,469 16,469 ▲0.050 ▲0.050
	0 0

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
9月3日時点 6,693,600	今積期の所要準備額 4,070,500
	9月5日以降の残り所要
	積数 600
	平均 100

国債短期証券入札予定

9月6日	3ヶ月(第1254回)
9月9日	6ヶ月(第1255回)
9月13日	3ヶ月
9月18日	1年

国債入札予定

9月5日	30年
9月10日	5年
9月12日	20年
9月26日	40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	4				9月4日	0
1年超3年以下	3500	3,500	4	11	18	25	9月4日	3
3年超5年以下	3750	3,750	4	11	18	25	9月4日	3
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					2023/4/14	-

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