



デイリーシグナル

2022年8月25日(木)

短期市場の推移

	8月19日	8月22日	8月23日	8月24日
加重平均金利	▲0.009	▲0.014	▲0.022	▲0.031
東京レポレート(TN)	▲0.088	▲0.088	▲0.092	▲0.096
無コール残	146,126	139,529	138,874	140,177
ON	71,208	65,936	63,721	64,084
その他	74,918	73,593	75,153	76,093
有コール残	30,608	29,724	29,809	30,526

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	▲0.060	0.001	▲0.038	▲0.094
T/N	▲0.030	▲0.025	▲0.029	▲0.101
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.027	▲0.013	▲0.020	▲0.107
2W	-	-	▲0.025	▲0.112
3W	-	-	-	▲0.117
1M	-	-	0.001	▲0.125
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.130
6M	-	-	-	▲0.147
1Y	-	-	-	▲0.144

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

8月26日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
特になし		(米)パウエルFRB議長講演	
-		(米)ミシガン大消費者信頼感(確報)	
-		-	

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.030%の合出から始まり、その後は主に▲0.055%~▲0.025%の水準で取引された。昨日に引き続き調達ニーズの減退傾向で、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.007%の▲0.038%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.040	▲0.040 ~ ▲0.025	▲0.055 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

週末3日積みとなるため調達意欲はやや持ち直し、出合水準は本日対比横ばいと予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月25日	8月26日	8月26日	8月29日	8月29日	8月29日
券	▲1,100		▲300		+1,000	
財政	+39,800		▲4,200		+2,000	
過不足	+38,700		▲4,500		+3,000	
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		+14,700				
CP等買入	▲100		▲900			
社債等買入	▲100					
国債補完供給	+7,400	▲7,200	+7,200			
当座預金増減	+53,400		+1,800		+3,000	
当座預金残高	5,396,000		5,397,800		5,400,800	
準備預金残高	4,716,200	主な需給要因				
積み終了先	4,715,700					
超過準備	4,715,400					
非準備先残高	679,800					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	32.3%					
乖離率	67.6%					

8月25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)(8/26~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(8/25~8/26)						
	7,133	7,133	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)

8月24日時点 6,594,800

所要

今積期の所要準備額 3,873,500

8月26日以降の残り所要

積数 3,600

平均 200

国庫短期証券入札予定

8月26日	3ヶ月(第1104回)
9月2日	3ヶ月
9月8日	6ヶ月
9月9日	3ヶ月

国債入札予定

8月30日	2年
9月1日	10年
9月6日	30年
9月13日	5年

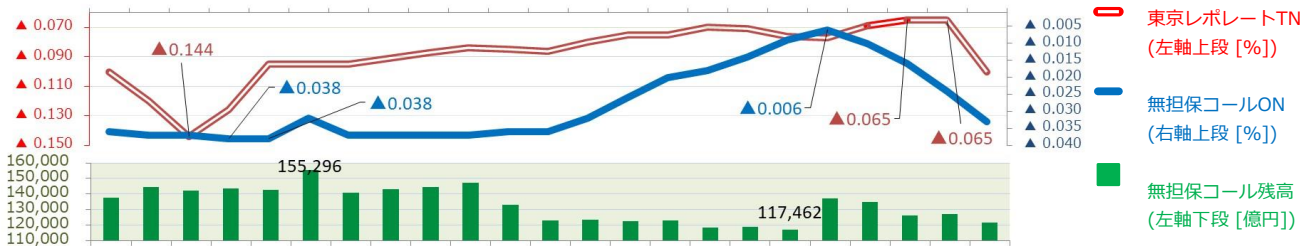
今月の国債買入オペ予定

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3日	0
1年超3年以下	4750	4,750	3 10 17 24	8月24日	0
3年超5年以下	4750	4,750	3 10 24 31	8月24日	1
5年超10年以下	5000	5,000	10 17 24 31	8月24日	1
10年超25年以下	1250	1,250	3 31	8月3日	1
25年超	500	500	17 31	8月17日	1
物価連動債	600	600	月1回	7月29日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	7月13日	0

1年前の市場推移

○2021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。



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