



短期市場の推移

	8月8日	8月9日	8月10日	8月14日
加重平均金利	▲0.073	▲0.074	▲0.072	▲0.068
東京レボレート(TN)	▲0.130	▲0.147	▲0.101	▲0.107
無コール残	143,460	150,699	139,904	149,977
ON	74,407	82,346	69,601	81,824
その他	69,053	68,353	70,303	68,153
有コール残	30,953	31,051	30,932	30,334

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	▲0.029	▲0.097
T/N	-	-	-	▲0.107
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.068	▲0.015	▲0.062	▲0.109
2W	▲0.045	0.001	▲0.013	▲0.111
3W	-	-	▲0.060	▲0.118
1M	-	-	▲0.035	▲0.124
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.035	▲0.122
6M	-	-	-	▲0.133
1Y	-	-	-	▲0.100

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

8月16日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
17:00	業態別の日銀当座預金残高(7月)		22:15	(米) 鉱工業生産(7月)
				(欧) ユーロ圏GDP(4月~6月) (二次速報)

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.060%の出会いから始まり、その後は主に▲0.045%~▲0.010%の水準で取引された。7月積み期最終日のため、最終調整を行いたい一部の取り手の調達意欲の旺盛さもあり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.039%の▲0.029%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.030 ~ ▲0.010	- ~ -	▲0.060 ~ ▲0.010

翌営業日のマーケット

積み替わりでもあるため、ビッドサイドの様子見姿勢から、出合水準は本日対比低下すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月15日		8月16日		8月17日	
券		+200		+500		▲2,000
財政		+68,700		▲26,600		+1,000
過不足		+68,900		▲26,100		▲1,000
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				+1,000		
共通担保(全店)				+7,300		
CP等買入	▲300	+4,000	▲5,000	▲100		
国債補充供給	+38,000	▲31,900	+31,900			
当座預金増減		+78,700		+9,000		▲1,000
当座預金残高		5,457,700		5,466,700		5,465,700
準備預金残高		4,781,500				
積み終了先		4,781,500				
超過準備		4,781,500				
非準備先残高		676,200				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		100.0%				
乖離率		0.0%				

8月15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(8/16~)	1,000	4,794	1,003	0.011	0.011	49.6
国債買入(固定利回り方式)(8/16~)						
5~10年		0	0			
5~10年		0	0			
米ドル資金供給(8/17~8/24)						
		1	1	5.580	5.580	
国債補充供給(8/15~8/16)						
	32,396	32,396	▲0.350	▲0.376		
	0	0				
共通担保(全店)(8/16~8/30)						
	7,250	7,250				
米ドル資金供給用担保国債供給(8/16~8/25)						
	5,000	2	2	▲0.100	▲0.100	

マネタリーベース (億円)
8月14日時点 6,639,800

所要	(億円)
来積期の所要準備額	4,009,600
8月16日以降の残り所要	
積数	4,009,600
平均	129,300

国庫短期証券入札予定

8月17日	1年(第1176回)
8月18日	3ヶ月(第1177回)
8月25日	3ヶ月
9月1日	3ヶ月

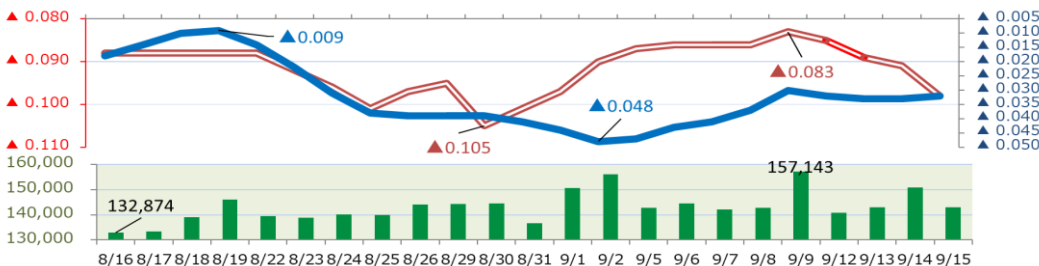
今月の国債買入オペ予定

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	7月5日	1
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	2 9 16 23	8月9日	2
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	2 9 23 30	8月9日	2
5年超10年以下	4,500~9,000	6,750	2 9 16 30	8月9日	2
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	2 9 23 30	8月9日	2
25年超	500~3,500	1,000	2 16 30	8月2日	2
物価連動債	600	600	月1回	7月26日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	4月14日	1

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