



短期市場の推移

[億円] [%]

	8月10日	8月14日	8月15日	8月16日
加重平均金利	▲0.072	▲0.068	▲0.029	▲0.060
東京レボレート(TN)	▲0.101	▲0.107	▲0.107	▲0.120
無コール残	139,904	149,977	134,076	128,932
ON	69,601	81,824	68,658	63,714
その他	70,303	68,153	65,418	65,218
有コール残	30,932	30,334	28,646	29,194

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	▲0.064	▲0.100
T/N	-	-	-	▲0.122
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.069	▲0.050	▲0.063	▲0.117
2W	▲0.068	0.000	▲0.050	▲0.118
3W	-	-	▲0.045	▲0.122
1M	-	-	-	▲0.127
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.126
6M	-	-	-	▲0.128
1Y	-	-	-	▲0.094

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

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月17日		8月18日		8月21日	
券	+100		+400		+1,500	
財政	+7,200		▲10,500		▲1,000	
過不足	+7,300		▲10,100		+500	
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	+13,300					
CP等買入	▲400		▲400			
国債補完供給	+31,500		+32,500			
当座預金増減	+19,200		+22,000		+500	
当座預金残高	5,454,900		5,476,900		5,477,400	
準備預金残高	4,758,100		主な需給要因			
積み終了先	4,666,600		国債発行(20年)		国庫短期証券発行・償還(3M)	
超過準備	4,278,100				国庫短期証券発行・償還(1Y)	
非準備先残高	696,800					
準備預金進捗率	97.6%					
平均	6.5%					
乖離率	91.2%					

8月17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)(8/18~)

5~10年 0 0

5~10年 0 0

社債等買入(8/22~)

1,000 2,339 1,000 0.278 0.293 86.1

国債補完供給(8/17~8/18)

32,923 32,923 ▲0.350 ▲0.363

0 0

マネタリーベース [億円]

8月16日時点 6,695,900

所要

[億円]

今積期の所要準備額 4,009,600

8月18日以降の残り所要

積数 96,100

平均 3,300

国庫短期証券入札予定

8月18日	3ヶ月(第1177回)
8月25日	3ヶ月
9月1日	3ヶ月
9月7日	6ヶ月

国債入札予定

8月29日	2年
9月5日	10年
9月7日	30年
9月12日	5年

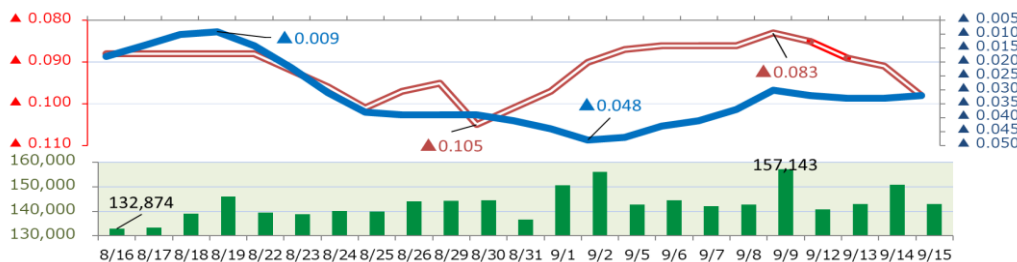
今日の国債買入オペ予定

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	0
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	2 9 16 23	8月16日	1
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16日	1
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16日	1
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。



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

東京レポレート
TN
(左軸上段 [%])

無担保コールON
(右軸上段 [%])

無担保コール残高