



短期市場の推移

	8月21日	8月22日	8月23日	8月24日
加重平均金利	▲0.065	▲0.064	▲0.064	▲0.063
東京レポレート(TN)	▲0.121	▲0.132	▲0.153	▲0.149
無コール残	157,597	164,616	165,193	168,889
ON	78,624	82,683	83,360	86,536
その他	78,973	81,933	81,833	82,353
有コール残	27,983	27,745	28,179	26,914

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	▲0.087	0.001	▲0.061	▲0.108
T/N	-	-	-	▲0.129
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	▲0.035	▲0.058	▲0.132
2W	▲0.064	▲0.020	▲0.059	▲0.132
3W	-	-	-	▲0.133
1M	-	-	0.180	▲0.139
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.133
6M	-	-	-	▲0.127
1Y	-	-	-	▲0.091

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28日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
	-		-	
	-		-	
	-		-	

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.065%の合出から始まり、その後は主に▲0.070%~▲0.055%の水準で取引された。週末3日積みで一部ビットサイドの積極的な調達姿勢も見られ、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.061%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.070 ~ ▲0.055

翌営業日のマーケット

週末3日積み要因の剥落により、出合水準は本日対比若干の低下を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月25日		8月28日		8月29日	
券		+0		+400		+1,000
財政		+18,200		+200		+1,000
過不足		+18,200		+600		+2,000
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	▲300		▲100			
社債等買入	▲300					
国債補完供給	+30,000	▲28,800	+28,800			
当座預金増減		+18,800		+29,300		+2,000
当座預金残高		5,469,200		5,498,500		5,500,500
準備預金残高		4,758,300	主な需給要因			
積み終了先		4,756,600	国庫短期証券発行・償還(3M)			
超過準備		4,756,600				
非準備先残高		710,900				
準備預金進捗率		99.6%				
平均		38.7%				
乖離率		60.9%				

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)(8/28~)						
5~10年	0	0	0			
5~10年	0	0	0			
国債補完供給(8/25~8/28)						
	29,250	29,250	▲0.350	▲0.363		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
8月24日時点 6,710,000

所要	(億円)
今積期の所要準備額	4,009,600
8月28日以降の残り所要	
積数	16,600
平均	900

国庫短期証券入札予定

9月1日	3ヶ月(第1179回)
9月7日	6ヶ月
9月8日	3ヶ月
9月15日	3ヶ月

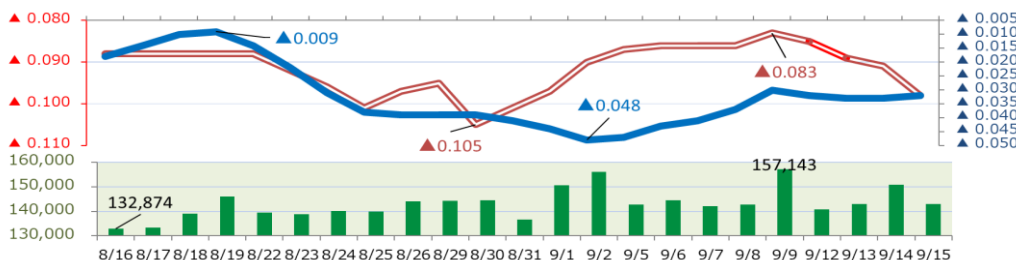
今月の国債買入オペ予定

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	8月16日	0
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	2 9 16 23	8月23日	0
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	2 9 23 30	8月23日	1
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23日	1
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。



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

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