



短期市場の推移

	8月23日	8月24日	8月25日	8月28日
加重平均金利	▲0.064	▲0.063	▲0.061	▲0.060
東京レポレート(TN)	▲0.153	▲0.149	▲0.129	▲0.163
無コール残	165,193	168,889	168,803	173,064
ON	83,360	86,536	85,650	89,881
その他	81,833	82,353	83,153	83,183
有コール残	28,179	26,914	27,443	24,886

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	▲0.055	▲0.122
T/N	-	-	-	▲0.161
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.065	▲0.055	▲0.061	▲0.163
2W	▲0.060	0.001	▲0.023	▲0.160
3W	-	-	-	▲0.158
1M	-	-	▲0.020	▲0.160
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.142
6M	-	-	-	▲0.124
1Y	-	-	-	▲0.092

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30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▲0.060%の合出から始まり、その後は主に▲0.065%~▲0.050%の水準で取引された。ビッドサイドの調達意欲の強まりもあり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.005%の▲0.055%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.065 ~ ▲0.050

翌営業日のマーケット

オファービッド動向に大きな変化はなく、出合水準は横ばい圏を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月29日	8月30日	8月30日	8月31日	8月31日	8月31日
券		▲200		+0		▲1,000
財政		▲1,300		▲2,300		▲200
過不足		▲1,500		▲2,300		▲1,200
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
国庫短期証券買入				+1,000		
共通担保(全店)			▲7,300	+8,800		
CP等買入	▲200					+4,000
社債等買入			▲100			
国債補充供給	+29,600	▲28,900	+28,900			
当座預金増減		▲1,000		+29,000		+2,800
当座預金残高		5,466,800		5,495,800		5,498,600
準備預金残高		4,761,300	主な需給要因			
積み終了先		4,759,600				
超過準備		4,759,600				
非準備先残高		705,500				
準備預金進捗率		99.7%				
平均		45.2%				
乖離率		54.5%				

8月29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(8/30~)	1,000	4,598	1,000	0.005	0.011	0.5
国債買入(固定利回り方式)(8/30~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(8/31~9/7)						
	0	0	5.80	5.80		
国債補充供給(8/29~8/30)						
	29,314	29,314	▲0.450	▲0.451		
	0	0				
共通担保(全店)(8/30~9/13)						
	8,831	8,831				

マネタリーベース [億円]
8月28日時点 6,727,100

所要	今積期の所要準備額	8月30日以降の残り所要
	4,009,600	
積数	12,900	
平均	800	

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

国債入札予定

9月5日	10年
9月7日	30年
9月12日	5年
9月14日	20年

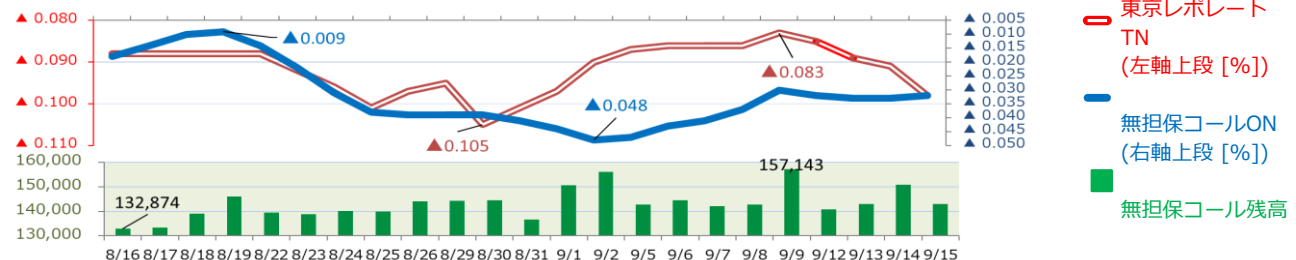
今月の国債買入オペ予定

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