



### 短期市場の推移

	8月9日	8月10日	8月14日	8月15日
加重平均金利	▲0.074	▲0.072	▲0.068	▲0.029
東京レボレート(TN)	▲0.147	▲0.101	▲0.107	▲0.107
無コール残	150,699	139,904	149,977	134,076
ON	82,346	69,601	81,824	68,658
その他	68,353	70,303	68,153	65,418
有コール残	31,051	30,932	30,334	28,646

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	▲0.060	▲0.098
T/N	-	-	-	▲0.120
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.064	▲0.058	▲0.061	▲0.115
2W	▲0.063	▲0.045	▲0.054	▲0.116
3W	-	-	▲0.045	▲0.119
1M	-	-	-	▲0.126
2M	-	-	0.002	-
3M	-	-	-	▲0.125
6M	-	-	-	▲0.129
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17日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		(欧) 6月貿易収支	

### 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▲0.065%~▲0.055%の水準で取引された。積み初日の為、調達サイドの慎重姿勢もみられ出合水準は低下し、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.031%の▲0.060%となった。

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

### 翌営業日のマーケット

主だった動態変化は見られず、出合水準は本日対比横ばい圏から若干の低下を想定。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月16日	8月17日	8月17日	8月18日	8月18日	8月18日
券	+500	+100	+100	▲1,000		
財政	▲26,100	+7,200	+7,200	▲12,000		
過不足	▲25,600	+7,300	+7,300	▲13,000		
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		+13,300		
国債買入						
共通担保(全店)	▲5,000	+7,300				
CP等買入	▲100		▲400			
国債補充供給	+31,900	▲31,500	+31,500			
当座預金増減	▲22,000	+51,700	+51,700	▲13,000		
当座預金残高	5,435,700	5,487,400	5,487,400	5,474,400		
準備預金残高	4,742,900					
積み終了先	2,987,300					
超過準備	1,309,300					
非準備先残高	692,800					
準備預金進捗率	85.6%					
平均	3.2%					
乖離率	82.4%					

### 8月16日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(固定利回り方式)(8/17~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(8/17~)						
~1年	1,500	8,126	1,503	0.006	0.006	73.1
1~3年	4,250	8,107	4,255	0.000	0.002	27.2
5~10年	6,750	9,880	6,756	▲0.002	0.003	21.7
25年~	1,000	1,610	1,001	0.005	0.008	15.0
国債補充供給(8/16~8/17)						
	31,975	31,975	▲0.350	▲0.364		
	0	0				

マナタリベース	所要
8月15日時点	6,718,300
今積期の所要準備額	4,009,600
8月17日以降の残り所要	
積数	576,000
平均	19,200

### 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
8月17日	20年
8月29日	2年
9月5日	10年
9月7日	30年

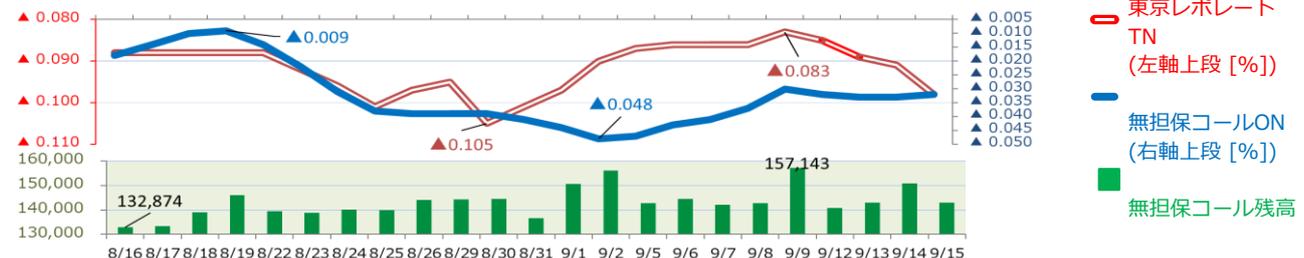
### 今月の国債買入オペ予定

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