



### 短期市場の推移

	8月14日	8月15日	8月16日	8月17日
加重平均金利	▲0.068	▲0.029	▲0.060	▲0.064
東京レポレート(TN)	▲0.107	▲0.107	▲0.120	▲0.122
無コール残	149,977	134,076	128,932	141,888
ON	81,824	68,658	63,714	70,565
その他	68,153	65,418	65,218	71,323
有コール残	30,334	28,646	29,194	29,023

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	▲0.064	▲0.114
T/N	-	-	-	▲0.120
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.117
2W	▲0.062	▲0.003	▲0.033	▲0.120
3W	-	-	▲0.060	▲0.123
1M	-	-	▲0.060	▲0.129
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.025	▲0.127
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21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%の出会いから始まり、その後は主に▲0.073%~▲0.060%の水準で取引された。出し手取り手共に主だった動向変化は見られず、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばい圏の▲0.064%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	▲0.073 ~ ▲0.060

### 翌営業日のマーケット

翌営業日のマーケットも大きな動態変化は見られず、出合水準は本日対比横ばい圏を想定。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月18日	8月21日	8月21日	8月22日	8月22日	8月22日
券	+400	+500	+500	+1,000	+1,000	+1,000
財政	▲14,300	+5,100	+5,100	+1,000	+1,000	+1,000
過不足	▲13,900	+5,600	+5,600	+2,000	+2,000	+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	▲400	▲100	▲100			
国債補充供給	+32,500	▲31,700	+31,700			
当座預金増減	▲13,500	+37,200	+37,200	+2,000	+2,000	+2,000
当座預金残高	5,441,400	5,478,600	5,478,600	5,480,600	5,480,600	5,480,600
準備預金残高	4,745,100	主な需給要因				
積み終了先	4,737,000	国庫短期証券発行・償還(3M)				
超過準備	4,724,600	国庫短期証券発行・償還(1Y)				
非準備先残高	696,300					
準備預金進捗率	99.1%					
平均	16.1%					
乖離率	83.0%					

### 8月18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)(8/21~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(8/18~8/21)						
	32,235	32,235	▲0.350	▲0.352		
	0	0				

マネタリーベース [億円]  
8月17日時点 6,714,900

所要	今積期の所要準備額	8月21日以降の残り所要	積数	平均
	4,009,600		34,700	1,300

### 国庫短期証券入札予定

8月25日	3ヶ月(第1178回)
9月1日	3ヶ月
9月7日	6ヶ月
9月8日	3ヶ月

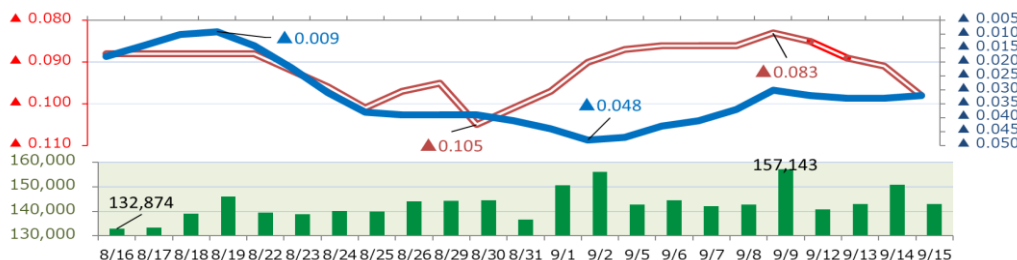
### 今月の国債買入オペ予定

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。



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