



### 短期市場の推移

	8月15日	8月16日	8月17日	8月18日
加重平均金利	▲0.029	▲0.060	▲0.064	▲0.064
東京レボレート(TN)	▲0.107	▲0.120	▲0.122	▲0.120
無コール残	134,076	128,932	141,888	155,644
ON	68,658	63,714	70,565	78,351
その他	65,418	65,218	71,323	77,293
有コール残	28,646	29,194	29,023	27,962

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	▲0.065	▲0.106
T/N	-	-	-	▲0.121
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.060	▲0.118
2W	▲0.070	▲0.065	▲0.068	▲0.121
3W	-	-	-	▲0.123
1M	-	-	-	▲0.129
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.028	▲0.126
6M	-	-	-	▲0.122
1Y	-	-	-	▲0.091

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22日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	23:00 (米) 中古住宅販売件数(7月)	▲0.2%
-	-	-	-
-	-	-	-

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.065%の割合から始まり、その後は主に▲0.072%~▲0.060%の水準で取引された。オファービッドの動向に大きな変化はなく、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.065%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	▲0.072 ~ ▲0.072	▲0.072 ~ ▲0.060

### 翌営業日のマーケット

引き続きオファービッドの動向に大きな変化は見られず、出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21日	8月22日	8月22日	8月23日	8月23日	8月23日
券		+400		+100		+0
財政		+5,000		▲6,900		▲5,000
過不足		+5,400		▲6,800		▲5,000
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	▲100		▲300			
社債等買入				+1,000		
国債補完供給	+31,700	▲32,800	+32,800			
当座預金増減		+4,200	+26,700			▲5,000
当座預金残高		5,445,600	5,472,300			5,467,300
準備預金残高		4,747,900				主な需給要因
積み終了先		4,744,100				流動性供給
超過準備		4,743,000				
非準備先残高		697,700				
準備預金進捗率		99.3%				
平均		19.4%				
乖離率		79.9%				

### 8月21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)(8/22~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(8/21~8/22)						
	33,239	33,239	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マナタリーベース [億円]  
8月18日時点 6,701,000

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,009,600
8月22日以降の残り所要	
積数	29,800
平均	1,200

### 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

### 国債入札予定

8月29日	2年
9月5日	10年
9月5日	30年
9月12日	5年

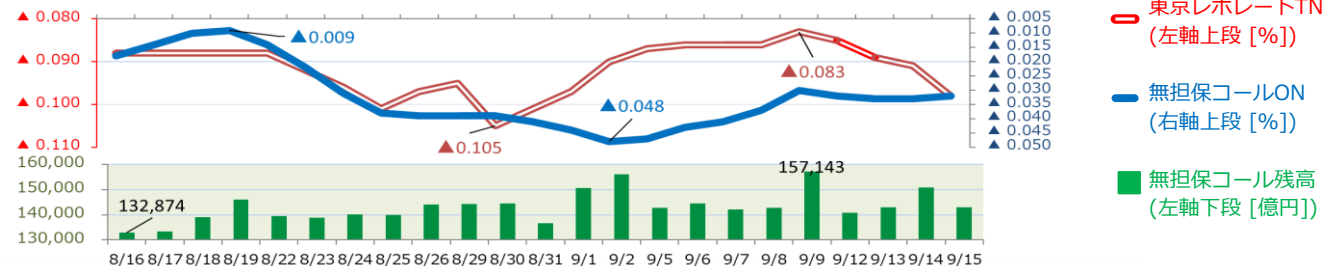
### 今月の国債買入オペ予定

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