



短期市場の推移

	8月16日	8月17日	8月18日	8月21日
加重平均金利	▲0.060	▲0.064	▲0.064	▲0.065
東京レポレート(TN)	▲0.120	▲0.122	▲0.120	▲0.121
無コール残	128,932	141,888	155,644	157,597
ON	63,714	70,565	78,351	78,624
その他	65,218	71,323	77,293	78,973
有コール残	29,194	29,023	27,962	27,983

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	▲0.108
T/N	-	-	-	▲0.132
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.072	▲0.060	▲0.066	▲0.125
2W	-	-	▲0.060	▲0.126
3W	-	-	-	▲0.129
1M	-	-	-	▲0.137
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.128
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23日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	23:00 (米) 新築住宅販売件数(7月)	-
-	-	(米) 製造業PMI (8月)	-
-	-	-	-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.070%の合出から始まり、その後は主に▲0.073%~▲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▲0.064%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

引き続きオファービッドの動態に変化は見られず、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22日	8月23日	8月23日	8月24日	8月24日	8月24日
券	+100	+100	+100	+0	+0	+0
財政	▲7,500	▲6,600	▲6,600	+1,000	+1,000	+1,000
過不足	▲7,400	▲6,500	▲6,500	+1,000	+1,000	+1,000
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		
CP等買入	▲300					
社債等買入		+1,000				
国債補完供給	+32,800	▲31,400	+31,400			
当座預金増減	▲5,300	+25,900	+25,900	+1,000	+1,000	+1,000
当座預金残高	5,440,300	5,466,200	5,466,200	5,467,200	5,467,200	5,467,200
準備預金残高	4,737,000	主な需給要因				
積み終了先	4,734,200	流動性供給				
超過準備	4,733,800					
非準備先残高	703,300					
準備預金進捗率	99.3%					
平均	22.6%					
乖離率	76.8%					

8月22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(8/23~)	1,000	3,581	1,000	0.010	0.010	
国債買入(固定利回り方式)(8/23~)						
5~10年	0	0	0			
5~10年	0	0	0			
米ドル資金供給(8/24~8/31)	1	1	5,580	5,580		
国債補完供給(8/22~8/23)	31,826	31,826	▲0.350	▲0.351		
	11	11	▲0.350	▲0.350		

マナタリベース	所要
8月21日時点	6,704,700
今積期の所要準備額	4,009,600
8月23日以降の残り所要	
積数	26,600
平均	1,100

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7日	30年
9月12日	5年

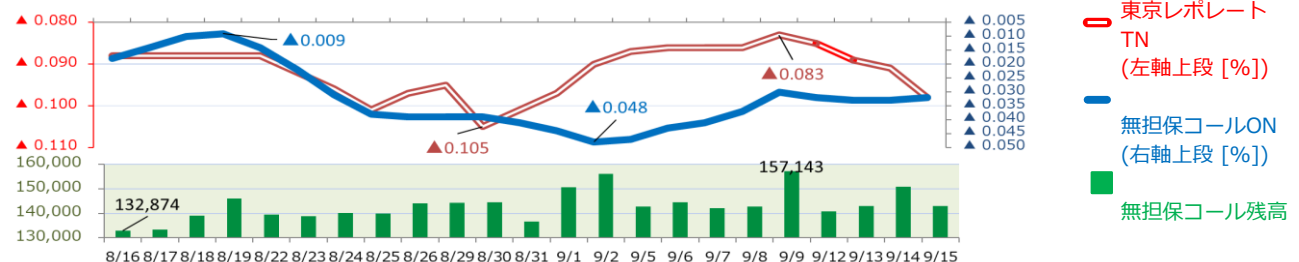
今月の国債買入オペ予定

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

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