



デイリーシグナル

2022年8月2日(火)

短期市場の推移

	7月27日	7月28日	7月29日	8月1日
加重平均金利	▲0.010	▲0.010	▲0.010	▲0.010
東京レポレート(TN)	▲0.118	▲0.204	▲0.137	▲0.111
無コール残	159,401	158,529	161,095	149,121
ON	83,318	82,181	86,977	79,033
その他	76,083	76,348	74,118	70,088
有コール残	29,248	29,111	27,996	26,062

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	▲0.040	0.001	▲0.009	▲0.103
T/N	▲0.010	▲0.008	▲0.010	▲0.127
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.009	▲0.027	▲0.137
2W	▲0.020	▲0.001	▲0.016	▲0.141
3W	-	-	-	▲0.145
1M	-	-	▲0.015	▲0.148
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.149
6M	-	-	-	▲0.150
1Y	-	-	-	▲0.142

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3日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	18:00 (欧)6月生産者物価指数[前年比]	35.7%
-	-	18:00 (欧)6月小売売上高[前月比]	0.0%
-	-	23:00 (米)7月ISM非製造業景況指数	53.9

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.009%の合出から始まり、その後は主に▲0.012%~▲0.007%の水準で取引された。ビッドサイドの調達意欲は引き続き強く、ON物加重平均金利(速報)も前営業日対比+0.001%の▲0.009%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.012 ~ ▲0.009	- ~ -	▲0.012 ~ ▲0.007

営業日のマーケット

明日もビッドサイドの調達ニーズは強く、出合水準は本日対比横ばいと予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	8月2日		8月3日		8月4日
券	+100		+400		▲1,000
財政	▲15,200		▲80,100		+0
過不足	▲15,100		▲79,700		▲1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入				+1,000	
共通担保(全店)			▲2,300	+2,100	
CP等買入			▲100		
社債等買入	▲200		▲200		
国債補充供給	+7,000	▲7,600	+7,600		
当座預金増減	▲15,900		▲71,600		▲1,000
当座預金残高	5,386,200		5,314,600		5,313,600
準備預金残高	4,702,900		4,702,900		4,702,900
積み終了先	4,702,900		消費税・法人税・		
超過準備	4,702,900		保険揚げ		
非準備先残高	683,300		国債発行(10年)		
準備預金進捗率	99.9%				
平均	58.1%				
乖離率	41.8%				

8月2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(8/3~)	1,000	6,637	1,000	0.016	0.016	
国債買入(固定利回り方式)(8/3~)	5~10年	0	0			
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(8/4~8/12)	0	0	2,580	2,580		
国債補充供給(8/2~8/3)	7,481	7,481	▲0.350	▲0.350		
0	0					
共通担保(全店)(8/3~8/17)	20,000	2,051	2,051			

マナタリーベース (億円)
8月1日時点 6,654,300

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,870,200
8月3日以降の残り所要	
積数	200
平均	0

国庫短期証券入札予定

8月5日	3ヶ月(第1099回)
8月9日	6ヶ月(第1100回)
8月12日	3ヶ月
8月18日	1年
8月4日	物価連動
8月9日	30年
8月16日	5年
8月18日	20年

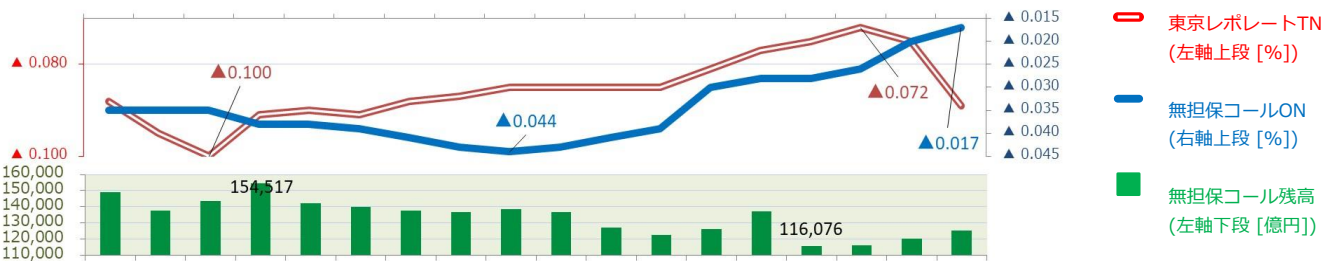
今月の国債買入オペ予定

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	7月6日	1
1年超3年以下	4750	4,750	3 10 17 24	7月25日	4
3年超5年以下	4750	4,750	3 10 24 31	7月29日	4
5年超10年以下	5000	5,000	10 17 24 31	7月29日	4
10年超25年以下	1250	1,250	3 31	7月25日	2
25年超	500	500	17 31	7月29日	2
物価連動債	600	600	月1回	7月29日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	7月13日	0

1年前の市場推移

○2021年7月積み期 [7月16日~8月13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