



## デイリーシグナル

2022年8月4日(木)

### 短期市場の推移

	7月29日	8月1日	8月2日	8月3日
加重平均金利	▲0.010	▲0.010	▲0.009	▲0.009
東京レボレート(TN)	▲0.137	▲0.111	▲0.127	▲0.099
無コール残	161,095	149,121	165,153	159,980
ON	86,977	79,033	90,885	83,847
その他	74,118	70,088	74,268	76,133
有コール残	27,996	26,062	27,095	29,568

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	▲0.040	0.001	▲0.009	▲0.095
T/N	▲0.010	▲0.008	▲0.010	▲0.100
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.018	▲0.009	▲0.010	▲0.119
2W	▲0.020	0.160	▲0.012	▲0.127
3W	-	-	-	▲0.133
1M	-	-	0.200	▲0.139
2M	-	-	0.020	-
3M	-	-	0.030	▲0.144
6M	-	-	-	▲0.150
1Y	-	-	-	▲0.141

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5日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 (米)7月非農業部門雇用者数	25.0万人
-	-	21:30 (米)7月失業率	3.6%
-	-	-	-

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▲0.008%の出合から始まり、その後は主に▲0.012%~▲0.008%の水準で取引された。引き続き資金調達ニーズは強く、ON物加重平均金利(速報)も前日対比横ばいの▲0.009%であった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.012 ~ ▲0.010	- ~ -	▲0.010 ~ ▲0.007

### 翌営業日のマーケット

3日積みみが資金調達ニーズに与える影響は小さいと思われ、出合水準は本日対比横ばいを予想する。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月4日	8月5日	8月4日	8月5日	8月4日	8月5日
券		▲500		+0		+1,000
財政		+400		+8,100		+3,000
過不足		▲100		+8,100		+4,000
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
国債買入		+12,400				
CP等買入				▲200		
国債補完供給	+6,600	▲6,200	+6,200			
当座預金増減		+12,700		+14,100		+4,000
当座預金残高		5,321,100		5,335,200		5,339,200
準備預金残高		4,658,000	主な需給要因			
積み終了先		4,658,000	物価連動国債発行			
超過準備		4,657,900	国庫短期証券発行・償還(3M)			
非準備先残高		663,100				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		64.5%				
乖離率		35.4%				

### 8月4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)(8/5~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(8/4~8/5)						
	6,066	6,058	▲0.350	▲0.357		
	0	0				

マネタリーベース [億円]  
8月3日時点 6,560,100

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,870,200
8月5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9日	30年
8月16日	5年
8月18日	20年
8月30日	2年

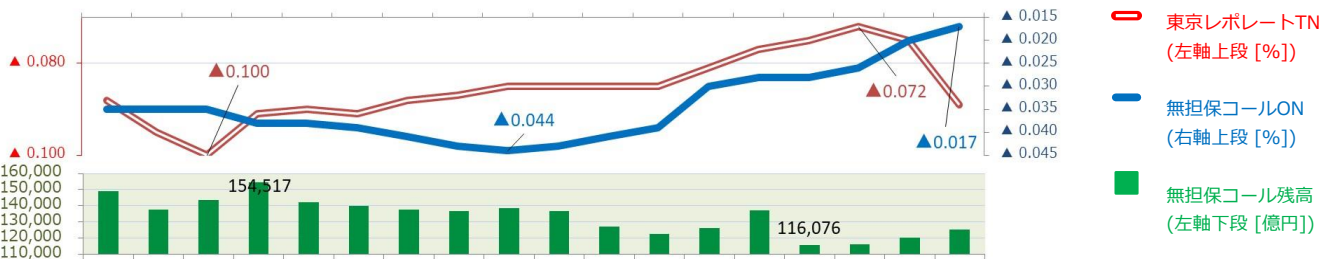
### 今月の国債買入オペ予定

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3日	0
1年超3年以下	4750	4,750	3 10 17 24	8月3日	3
3年超5年以下	4750	4,750	3 10 24 31	8月3日	3
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	8月3日	1
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