



## デイリーシグナル

2022年8月9日(火)

### 短期市場の推移

	8月3日	8月4日	8月5日	8月8日
加重平均金利	▲0.009	▲0.009	▲0.009	▲0.009
東京レポレート(TN)	▲0.099	▲0.100	▲0.092	▲0.088
無コール残	159,980	158,235	160,814	154,958
ON	83,847	82,442	83,971	77,815
その他	76,133	75,793	76,843	77,143
有コール残	29,568	29,158	29,299	28,834

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	▲0.087
T/N	-	-	▲0.010	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.010	▲0.034	▲0.100
2W	▲0.020	▲0.001	▲0.013	▲0.112
3W	-	-	-	▲0.121
1M	-	-	-	▲0.127
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.028	▲0.132
6M	-	-	-	▲0.147
1Y	-	-	-	▲0.140

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

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月9日	8月10日	8月10日	8月12日	8月12日	8月12日
券		▲200		▲700		▲1,000
財政		▲4,400		▲23,500		▲2,000
過不足		▲4,600		▲24,200		▲3,000
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		▲800			
国債補充供給	+9,900	▲10,500	+10,500			
当座預金増減		▲5,300		▲14,500		▲3,000
当座預金残高		5,321,400		5,306,900		5,303,900
準備預金残高		4,685,800				主な需給要因
積み終了先		4,685,800		国庫短期証券発行・償還(6M)		
超過準備		4,685,800		国債発行(30年)		
非準備先残高		635,600				
準備預金進捗率		99.9%				
平均乖離率		80.6%				
		19.3%				

### 8月9日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(固定利回り方式)(8/10~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(8/12~8/18)						
	0	0	2,600	2,600		
CP等買入(8/15~)						
	4,000	12,375	3,972	0.000	0.001	16.1
国債補充供給(8/9~8/10)						
	10,380	10,380	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース (億円)  
 8月8日時点 6,578,600

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,873,200
8月10日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

### 国庫短期証券入札予定

8月12日	3ヶ月(第1101回)
8月18日	1年
8月19日	3ヶ月
8月26日	3ヶ月
8月16日	5年
8月18日	20年
8月30日	2年
9月1日	10年

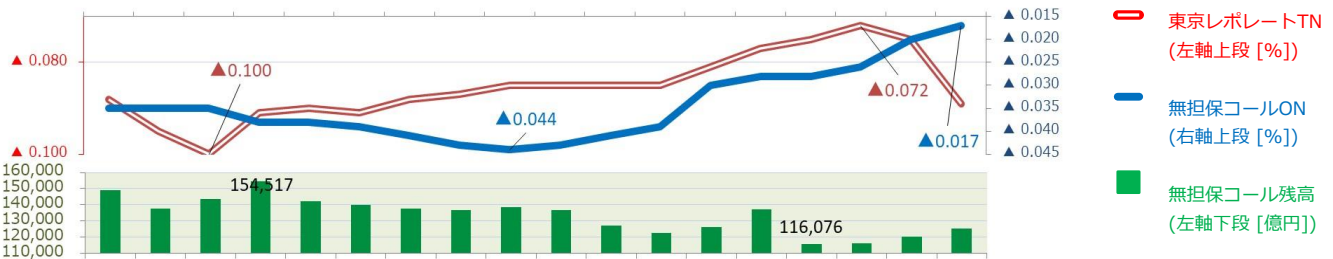
### 今月の国債買入オペ予定

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