



短期市場の推移

	7月26日	7月27日	7月28日	7月31日
加重平均金利	▲0.073	▲0.071	▲0.059	▲0.061
東京レボレート(TN)	▲0.097	▲0.097	▲0.099	▲0.096
無コール残	148,124	163,002	158,099	165,241
ON	69,541	69,846	73,525	97,588
その他	78,583	93,156	84,574	67,653
有コール残	31,744	31,084	31,404	29,881

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	▲0.063	▲0.091
T/N	-	-	-	▲0.095
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.065	▲0.106
2W	▲0.065	▲0.035	▲0.056	▲0.108
3W	-	-	-	▲0.113
1M	-	-	-	▲0.120
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.028	▲0.128
6M	-	-	-	▲0.129
1Y	-	-	-	▲0.101

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2日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	金融政策決定会合議事要旨 (6月15、16日開催分)		(米) ADP雇用統計 (7月)	
15:00	財政資金対民間収支の実績 (6月)		-	
	-		-	

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.060%の合出から始まり、その後は主に▲0.080%~▲0.055%の水準で取引された。ビットサイドの調達意欲が減退し、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.063%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.075	▲0.087 ~ ▲0.085	▲0.080 ~ ▲0.055

翌営業日のマーケット

ビットサイドの調達意欲は減退傾向がみられ、出合いの水準は本日対比低下すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月1日	8月2日	8月2日	8月3日	8月3日	8月3日
券		+100		+600		▲1,000
財政		▲25,100		▲91,300		+0
過不足		▲25,000		▲90,700		▲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				
国債買入		+3,200				
共通担保(全店)			▲9,000	+5,000		
国債補充供給	+50,900	▲49,500	+49,500			
当座預金増減		▲19,400		▲45,200		▲1,000
当座預金残高		5,408,700		5,363,500		5,362,500
準備預金残高		4,713,300				主な需給要因
積み終了先		4,712,000	法人税・消費税揚げ、			
超過準備		4,711,700	保険揚げ			
非準備先残高		695,400	国債発行(10年)			
準備預金進捗率		99.7%				
平均		54.8%				
乖離率		44.9%				

8月1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)(8/2~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(8/3~8/10)						
	0	0	5,580	5,580		
国債補充供給(8/1~8/2)						
	50,128	50,128	▲0.350	▲0.351		
	0	0				
共通担保(全店)(8/2~8/16)						
	5,000	5,000				

マネタリーベース (億円)
7月31日時点 6,688,600

所要	(億円)
今積期の所要準備額	4,015,900
8月2日以降の残り所要	
積数	10,300
平均	700

国庫短期証券入札予定

8月4日	3ヶ月(第1173回)
8月9日	6ヶ月
8月10日	3ヶ月
8月17日	1年

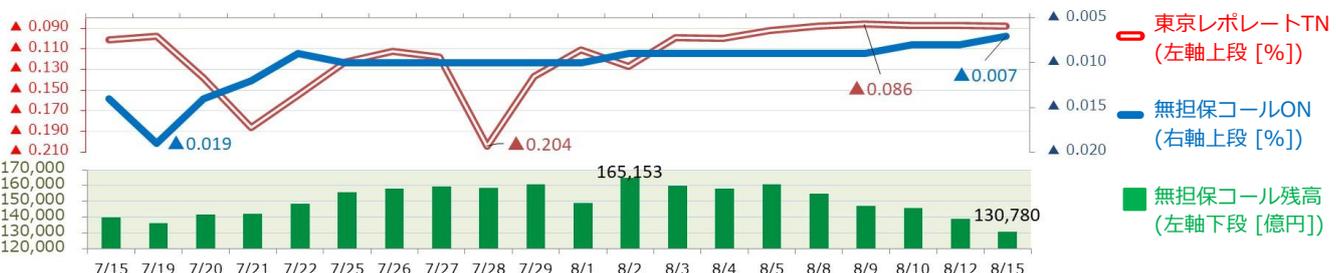
今月の国債買入オペ予定

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5日	1
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	2 9 16 23	7月20日	4
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	2 9 23 30	7月26日	4
5年超10年以下	4,500~9,000	3,000	2 9 16 30	7月31日	4
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	2 9 23 30	7月26日	4
25年超	500~3,500	1,000	2 16 30	7月26日	3
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7月積み期 [7月15日~8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