



短期市場の推移

	7月27日	7月28日	7月31日	8月1日
加重平均金利	▲0.071	▲0.059	▲0.061	▲0.063
東京レポレート(TN)	▲0.097	▲0.099	▲0.096	▲0.095
無コール残	163,002	158,099	165,241	156,358
ON	87,164	85,411	97,588	89,215
その他	75,838	72,688	67,653	67,143
有コール残	31,084	31,404	29,881	29,995

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	▲0.070	▲0.092
T/N	-	-	-	▲0.100
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.001	▲0.104
2W	▲0.060	0.001	▲0.053	▲0.111
3W	-	-	0.001	▲0.115
1M	-	-	0.001	▲0.119
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.128
6M	-	-	-	▲0.129
1Y	-	-	-	▲0.101

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
		(米)週間の 新規失業保険申請件数	
-			
-			

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.065%の出会いから始まり、その後は主に▲0.080%~▲0.060%の水準で取引された。昨日に引き続きビッドサイドの調達意欲が減退しており、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.007%の▲0.070%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.075	- ~ -	▲0.080 ~ ▲0.060

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲は弱く、出会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2日	8月3日	8月3日	8月4日	8月4日	8月4日
券	+600		▲800		+0	
財政	▲92,400		+2,000		▲3,000	
過不足	▲91,800		+1,200		▲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
国債買入				+18,100		
共通担保(全店)	▲9,000	+5,000				
CP等買入			▲100			
国債補完供給	+49,500	▲42,400	+42,400			
当座預金増減	▲88,700		+61,600		▲3,000	
当座預金残高	5,320,000		5,381,600		5,378,600	
準備預金残高	4,645,200					
積み終了先	4,644,100					
超過準備	4,644,100					
非準備先残高	674,800					
準備預金進捗率	99.8%					
平均	58.1%					
乖離率	41.7%					

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
国債買入(固定利回り方式)(8/3~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(8/3~)						
1~3年	4,250	10,843	4,258	0.005	0.006	66.0
3~5年	4,500	7,355	4,503	0.011	0.013	77.1
5~10年	6,750	14,568	6,755	0.012	0.013	71.8
10~25年	2,000	3,660	2,008	0.015	0.018	75.1
25年~	1,000	2,695	1,000	0.017	0.019	20.1
国債補完供給(8/2~8/3)						
42,806	42,806	▲0.350	▲0.351			
79	79	▲0.350	▲0.350			

マネタリーベース	所要
8月1日時点	6,669,000

今積期の所要準備額	積数	平均
8月3日以降の残り所要	4,015,900	9,200
		700

国債短期証券入札予定

8月4日	3ヶ月(第1173回)
8月9日	6ヶ月(第1174回)
8月10日	3ヶ月
8月17日	1年

国債入札予定

8月3日	物価運動
8月8日	30年
8月15日	5年
8月17日	20年

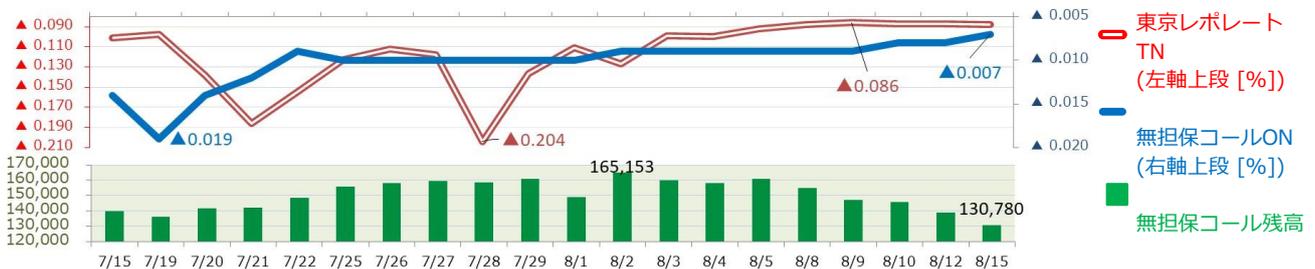
今月の国債買入オペ予定

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5日	1
1年超3年以下	3,500~6,500	4,250	2 9 16 23	8月2日	3
3年超5年以下	4,000~7,500	4,500	2 9 23 30	8月2日	3
5年超10年以下	4,500~9,000	6,750	2 9 16 30	8月2日	3
10年超25年以下	1,000~5,000	2,000	2 9 23 30	8月2日	3
25年超	500~3,500	1,000	2 16 30	8月2日	2
物価運動債	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