



短期市場の推移

	7月28日	7月31日	8月1日	8月2日
加重平均金利	▲0.059	▲0.061	▲0.063	▲0.070
東京レボレート(TN)	▲0.099	▲0.096	▲0.095	▲0.100
無コール残	158,099	165,241	156,358	151,067
ON	85,411	97,588	89,215	83,909
その他	72,688	67,653	67,143	67,158
有コール残	31,404	29,881	29,995	29,977

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	▲0.070	▲0.094
T/N	-	-	-	▲0.101
S/N	-	-	▲0.055	-
1W	▲0.058	▲0.048	▲0.053	▲0.104
2W	▲0.045	0.020	▲0.018	▲0.109
3W	-	-	-	▲0.114
1M	▲0.010	0.250	0.072	▲0.119
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.128
6M	-	-	-	▲0.129
1Y	-	-	-	▲0.101

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

8月4日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30	(米) 雇用統計 (7月)
-	-	-	-
-	-	-	-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.070%の出会いから始まり、その後は主に▲0.080%~▲0.065%の水準で取引された。引き続きビッドサイドの調達意欲の弱さがみられ、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.070%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.075	- ~ -	▲0.080 ~ ▲0.065

翌営業日のマーケット

週末三日積みであるものの、引き続き調達意欲の弱さがみられるため、出会いの水準は本日対比横ばい圏で推移すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	8月3日		8月4日		8月7日
券	▲800		+200		+400
財政	+1,600		▲400		▲2,000
過不足	+800		▲200		▲1,600
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入		+18,100		+4,200	
CP等買入	▲100		▲100		
国債補完供給	+42,400	▲39,000	+39,000		
当座預金増減	+22,200		+42,900		▲1,600
当座預金残高	5,342,200		5,385,100		5,383,500
準備預金残高	4,666,300		主な需給要因		
積み終了先	4,665,000		物価連動債発行 (10年)		国庫短期証券発行・償還 (3M)
超過準備	4,665,000				
非準備先残高	675,900				
準備預金進捗率	99.8%				
平均	61.3%				
乖離率	38.5%				

8月3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)(8/4~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(8/3~8/4)						
	39,458	39,458	▲0.350	▲0.352		
	0	0				
国債買入(8/4~)						
3~5年	1,000	1,510	1,000	0.013	0.020	30.0
5~10年	3,000	7,191	3,005	0.016	0.020	67.1

マネタリーベース (億円)
 8月2日時点 6,579,700

所要	所要
今積期の所要準備額	4,015,900
8月4日以降の残り所要	
積数	7,900
平均	700

国庫短期証券入札予定

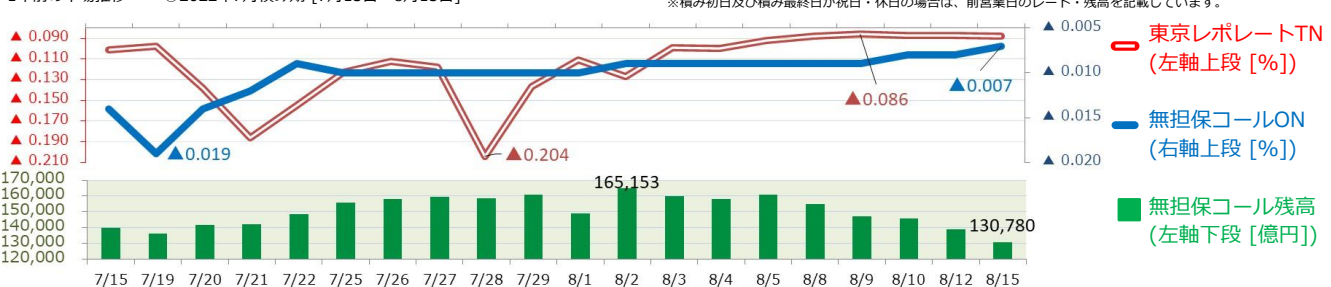
8月4日	3ヶ月(第1173回)
8月9日	6ヶ月(第1174回)
8月10日	3ヶ月(第1175回)
8月17日	1年
8月8日	30年
8月15日	5年
8月17日	20年
8月29日	2年

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	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	1,000	2 9 23 30	8月3日	3
5年超10年以下	4,500~9,000	3,000	2 9 16 30	8月3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]



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