



短期市場の推移

	7月31日	8月1日	8月2日	8月3日
加重平均金利	▲0.061	▲0.063	▲0.070	▲0.070
東京レポレート(TN)	▲0.096	▲0.095	▲0.100	▲0.101
無コール残	165,241	156,358	151,067	146,719
ON	97,588	89,215	83,909	78,406
その他	67,653	67,143	67,158	68,313
有コール残	29,881	29,995	29,977	31,113

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	▲0.072	▲0.096
T/N	-	-	-	▲0.102
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.050	▲0.045	▲0.048	▲0.106
2W	▲0.075	▲0.003	▲0.018	▲0.109
3W	-	-	-	▲0.114
1M	-	-	-	▲0.120
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.126
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7日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
15:00	7月コール市場残高			
	-		-	
	-		-	

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%~▲0.070%の水準で取引された。ビッドサイドの慎重姿勢は変わらず、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.002%の▲0.072%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.080 ~ ▲0.070

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの調達量減少もあり、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4日	8月7日	8月4日	8月7日	8月4日	8月7日
券	+300	+300	+300	+300	▲1,000	▲1,000
財政	▲100	+3,200	+3,200	+3,200	▲1,000	▲1,000
過不足	+200	+3,500	+3,500	+3,500	▲2,000	▲2,000
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		+4,200				
CP等買入	▲100		▲100			
国債補完供給	+39,000	▲34,900	+34,900			
当座預金増減	+8,400	+38,300	+38,300		▲2,000	
当座預金残高	5,350,600	5,388,900	5,388,900		5,386,900	
準備預金残高	4,664,000					
積み終了先	4,662,800					
超過準備	4,662,600					
非準備先残高	686,600					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	71.0%					
乖離率	28.9%					

8月4日のオペ結果

オベ種類 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)(8/7~)

5~10年 0 0

5~10年 0 0

国債補完供給(8/4~8/7)

35,319 35,319 ▲0.350 ▲0.352

108 108 ▲0.350 ▲0.350

マネタリーベース (億円)
8月3日時点 6,602,600

所要	(億円)
今積期の所要準備額	4,015,900
8月7日以降の残り所要	
積数	3,500
平均	400

国庫短期証券入札予定

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18日	3ヶ月

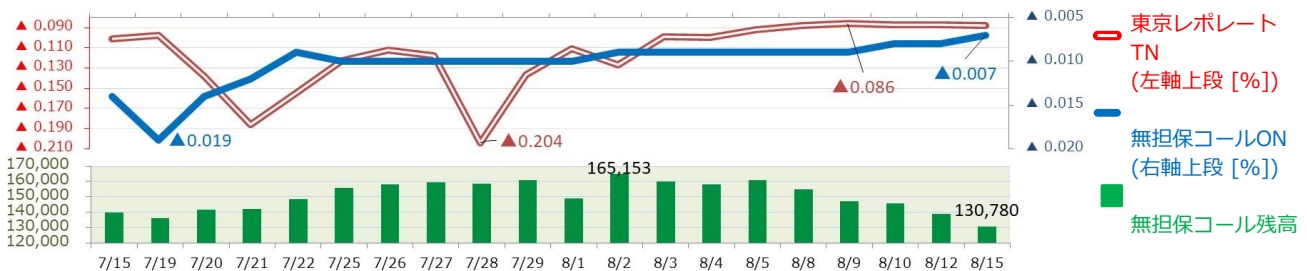
今月の国債買入オペ予定

オベ種類	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

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