



短期市場の推移

	8月1日	8月2日	8月3日	8月4日
加重平均金利	▲0.063	▲0.070	▲0.070	▲0.072
東京レボレート(TN)	▲0.095	▲0.100	▲0.101	▲0.102
無コール残	156,358	151,067	146,719	146,775
ON	89,215	83,909	78,406	77,642
その他	67,143	67,158	68,313	69,133
有コール残	29,995	29,977	31,113	30,432

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	▲0.075	▲0.096
T/N	-	-	-	▲0.103
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	▲0.068	▲0.069	▲0.106
2W	▲0.068	0.030	▲0.057	▲0.109
3W	-	-	-	▲0.114
1M	-	-	-	▲0.119
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.004	▲0.123
6M	-	-	-	▲0.129
1Y	-	-	-	▲0.100

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8日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.074%の出会いから始まり、その後は主に▲0.085%~▲0.070%の水準で取引された。引き続きビッドサイドには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▲0.003%の▲0.075%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.085	- ~ -	▲0.080 ~ ▲0.070

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの慎重姿勢に変化はなく、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7日	8月8日	8月8日	8月9日	8月9日	8月9日
券		+300		▲200		▲2,000
財政		+5,100		▲100		▲12,000
過不足		+5,400		▲300		▲14,000
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		▲100			
国債補充供給	+34,900	▲31,300	+31,300			
当座預金増減		+8,900		+30,900		▲14,000
当座預金残高		5,359,500		5,390,400		5,376,400
準備預金残高		4,676,900	主な需給要因			
積み終了先		4,676,400	国債発行(30年)			
超過準備		4,675,900				
非準備先残高		682,600				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		74.2%				
乖離率		25.7%				

8月7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)(8/8~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(8/7~8/8)						
	31,817	31,817	▲0.350	▲0.351		
	4	4	▲0.350	▲0.350		

マナタリベース	所要
8月4日時点	6,610,800
今積期の所要準備額	4,017,300
8月8日以降の残り所要	
積数	2,400
平均	300

国庫短期証券入札予定

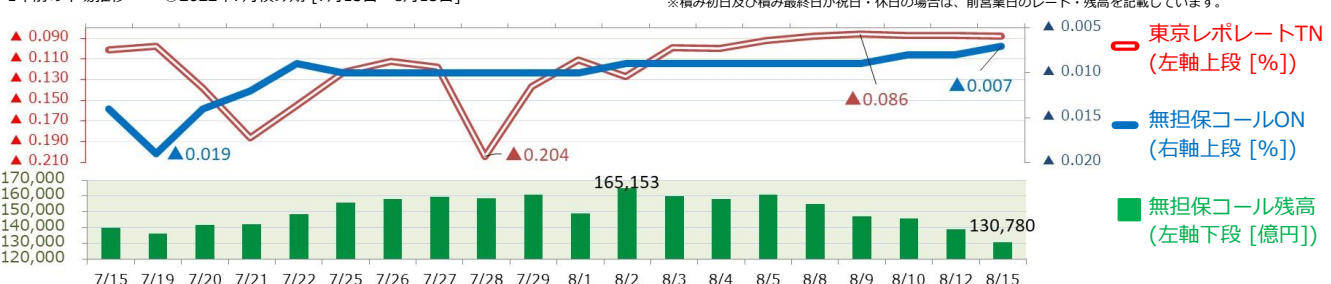
8月9日	6ヶ月(第1174回)
8月10日	3ヶ月(第1175回)
8月17日	1年
8月18日	3ヶ月
8月8日	30年
8月15日	5年
8月17日	20年
8月29日	2年

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

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