



### 短期市場の推移

	8月2日	8月3日	8月4日	8月7日
加重平均金利	▲0.070	▲0.070	▲0.072	▲0.075
東京レポレート(TN)	▲0.100	▲0.101	▲0.102	▲0.103
無コール残	151,067	146,719	146,775	136,399
ON	83,909	78,406	77,642	67,946
その他	67,158	68,313	69,133	68,453
有コール残	29,977	31,113	30,432	31,274

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	▲0.073	▲0.108
T/N	-	-	-	▲0.130
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.070	▲0.040	▲0.063	▲0.123
2W	-	-	-	▲0.120
3W	-	-	-	▲0.120
1M	-	-	-	▲0.126
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.123
6M	-	-	-	▲0.129
1Y	-	-	-	▲0.100

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9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▲0.075%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。ビッドサイドの調達意欲に変化は見られず、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.073%となった。また、本日公表された8月積み期間に適用する基準比率は、前積み期対比+2.5%の67.0%となった。

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

### 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8日		8月9日		8月10日	
券	▲200		▲400		▲2,000	
財政	+500		▲11,900		+15,000	
過不足	+300		▲12,300		+13,000	
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		
CP等買入	▲100		▲100			
国債補完供給	+31,300	▲30,500	+30,500			
当座預金増減	+1,000		+19,100		+13,000	
当座預金残高	5,360,500		5,379,600		5,392,600	
準備預金残高	4,657,700		主な需給要因			
積み終了先	4,657,200		国債発行 (30年)		国庫短期証券発行・償還 (6M)	
超過準備	4,657,200					
非準備先残高	702,800					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	77.4%					
乖離率	22.5%					

### 8月8日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(8/9~)	1,000	4,288	1,002	0.010	0.012	49.6
国債買入(固定利回り方式)(8/9~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(8/10~8/17)						
0	0	5.580	5.580			
国債補完供給(8/8~8/9)						
30,958	30,958	▲0.350	▲0.351			
0	0					

マナタリベース (億円) 8月7日時点 6,619,300

所要	今積期の所要準備額
8月9日以降の残り所要	4,017,300
積数	1,900
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

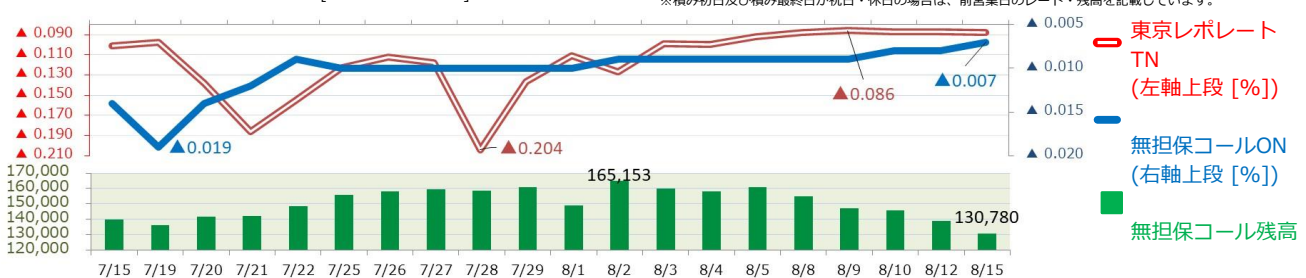
### 今月の国債買入オペ予定

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]

※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