



短期市場の推移

	8月3日	8月4日	8月7日	8月8日
加重平均金利	▲0.070	▲0.072	▲0.075	▲0.073
東京レポレート(TN)	▲0.101	▲0.102	▲0.103	▲0.130
無コール残	146,719	146,775	136,399	143,460
ON	78,406	77,642	67,946	74,407
その他	68,313	69,133	68,453	69,053
有コール残	31,113	30,432	31,274	30,953

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	▲0.074	▲0.103
T/N	▲0.080	▲0.060	▲0.076	▲0.147
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.133
2W	-	-	▲0.065	▲0.127
3W	-	-	-	▲0.126
1M	-	-	-	▲0.135
2M	-	-	0.015	-
3M	-	-	-	▲0.124
6M	-	-	-	▲0.130
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10日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
-	-	-	21:30	(米) 7月消費者物価	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-

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▲0.001%の▲0.074%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.087	- ~ -	▲0.083 ~ ▲0.070

翌営業日のマーケット

週末ではあるものの、ビッドサイドの調達意欲は弱含み、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9日	8月10日	8月9日	8月10日	8月14日	8月15日
券	▲500	▲600	▲500	▲600	+3,000	+3,000
財政	▲10,100	+15,900	▲10,100	+15,900	▲1,000	▲1,000
過不足	▲10,600	+15,300	▲10,600	+15,300	+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
国庫短期証券買入		+1,000		+17,500		+17,500
国債買入				▲800		▲800
CP等買入	▲100		▲100			▲100
社債等買入						
国債補充供給	+30,500	▲29,800	+30,500	▲29,800		
当座預金増減	▲9,000	+61,700	▲9,000	+61,700	+2,000	+2,000
当座預金残高	5,351,500	5,413,200	5,351,500	5,413,200	5,415,200	5,415,200
準備預金残高	4,643,800	4,643,300	4,643,800	4,643,300	4,643,300	4,643,300
積み終了先						
超過準備	4,643,200	4,643,200	4,643,200	4,643,200	4,643,200	4,643,200
非準備先残高	707,700	707,700	707,700	707,700	707,700	707,700
準備預金進捗率	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%
平均	80.6%	80.6%	80.6%	80.6%	80.6%	80.6%
乖離率	19.3%	19.3%	19.3%	19.3%	19.3%	19.3%

8月9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)(8/10~)						
5~10年	0	0	0	0		
5~10年	0	0	0	0		
国債買入(8/10~)						
1~3年	4,250	8,807	4,255	▲0.004	▲0.003	67.1
3~5年	4,500	8,380	4,505	▲0.014	▲0.011	48.3
5~10年	6,750	10,524	6,756	▲0.028	▲0.025	81.2
10~25年	2,000	3,683	2,004	▲0.032	▲0.030	91.4
CP等買入(8/15~)						
	4,000	8,768	4,001	▲0.002	0.006	46.2
国債補充供給(8/9~8/10)						
	30,198	30,198	▲0.350	▲0.351		
	0	0				

マナターベース	所要
8月8日時点	6,620,600

今積期の所要準備額	4,017,300
8月10日以降の残り所要	
積数	1,300
平均	200

国庫短期証券入札予定

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25日	3ヶ月
8月15日	5年
8月17日	20年
8月29日	2年
9月5日	10年

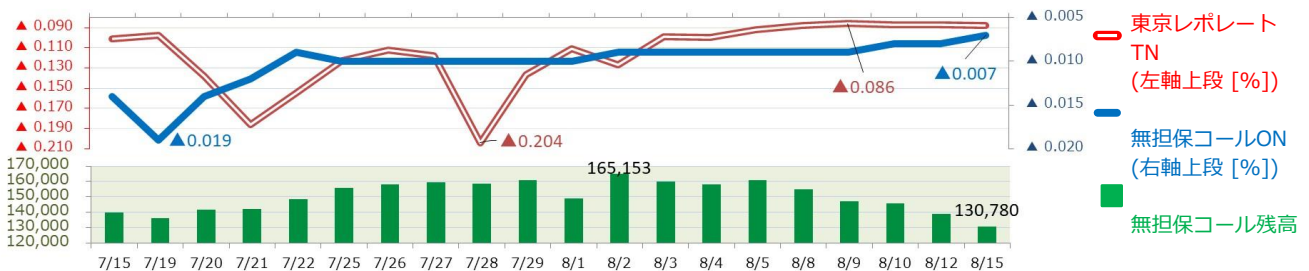
今月の国債買入オペ予定

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