



### 短期市場の推移

	8月4日	8月7日	8月8日	8月9日
加重平均金利	▲0.072	▲0.075	▲0.073	▲0.074
東京レボレート(TN)	▲0.102	▲0.103	▲0.130	▲0.147
無コール残	146,775	136,399	143,460	150,699
ON	77,642	67,946	74,407	82,346
その他	69,133	68,453	69,053	68,353
有コール残	30,432	31,274	30,953	31,051

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	▲0.072	▲0.098
T/N	-	-	-	▲0.101
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.010	▲0.107
2W	-	-	-	▲0.112
3W	-	-	-	▲0.116
1M	-	-	▲0.033	▲0.124
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.122
6M	-	-	-	▲0.131
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14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▲0.070%の出会いから始まり、その後は主に▲0.085%~▲0.060%の水準で取引された。一部オファーサイドで放出を控える動きがあり、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
▲ 0.085 ~ ▲ 0.085	- ~ -	▲ 0.080 ~ ▲ 0.060

### 翌営業日のマーケット

オファーサイド・ビッドサイド共に大きな変化はなく、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10日	8月14日	8月15日
券	▲600	+400	+1,000
財政	+15,400	+200	+68,000
過不足	+14,800	+600	+69,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+17,500	
CP等買入	▲800		+4,000
社債等買入	▲100		
国債補充供給	+29,800	▲29,100	+29,100
当座預金増減	+32,100	+29,700	+73,000
当座預金残高	5,383,600	5,413,300	5,486,300
準備預金残高	4,694,900	主な需給要因	
積み終了先	4,694,900	国庫短期証券発行・償還 (3M)	個人国債発行・償還
超過準備	4,694,600	年金定時払い	源泉所得税揚げ
非準備先残高	688,700		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	93.5%		
乖離率	6.5%		

### 8月10日のオペ結果

【%】(億円)※米ドル資金供給は百万\$

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)(8/14~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(8/10~8/14)						
	29,398	29,398	▲0.350	▲0.350		
	1	1	▲0.350	▲0.360		

### マナタリーベース (億円)

8月9日時点 6,612,000

### 所要 (億円)

今積期の所要準備額	4,017,300
8月14日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

### 国庫短期証券入札予定

8月17日	1年 (第1176回)
8月18日	3ヶ月 (第1177回)
8月25日	3ヶ月
9月1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

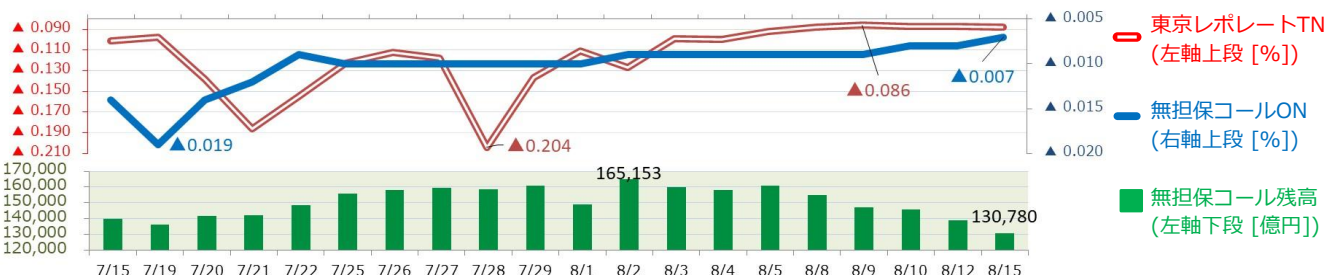
### 今月の国債買入オペ予定

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