



短期市場の推移

	8月7日	8月8日	8月9日	8月10日
加重平均金利	▲0.075	▲0.073	▲0.074	▲0.072
東京レポレート(TN)	▲0.103	▲0.130	▲0.147	▲0.101
無コール残	136,399	143,460	150,699	139,904
ON	67,946	74,407	82,346	69,601
その他	68,453	69,053	68,353	70,303
有コール残	31,274	30,953	31,051	30,932

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	▲0.068	▲0.108
T/N	-	-	-	▲0.107
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.111
2W	▲0.059	▲0.010	▲0.048	▲0.114
3W	-	-	0.001	▲0.118
1M	-	-	0.350	▲0.125
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.123
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15日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	4~6月の実質GDP (1次速報値)	市場予想 前期比増率 2.4%増	-	-
13:30	6月の鉱工業生産確報 (経産省)	-	-	-
	-	-	-	-

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。ビッドサイドの調達意欲の高まりもあり、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.004%の▲0.068%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.075	- ~ -	▲0.080 ~ ▲0.060

翌営業日のマーケット

積み最終日の調達サイドのニーズの強まりから、出合水準は本日対比上昇を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月14日		8月15日		8月16日	
券	+400		+100		+1,000	
財政	+3,900		+69,600		▲28,000	
過不足	+4,300		+69,700		▲27,000	
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
共通担保(全店)					▲5,000	
CP等買入			▲300	+4,000		
国債補完供給	+29,100	▲38,000	+38,000			
当座預金増減	▲4,600		+111,400		▲32,000	
当座預金残高	5,379,000		5,490,400		5,458,400	
準備預金残高	4,721,400		主な需給要因			
積み終了先	4,721,400		個人国債発行・償還		国債発行(5年)	
超過準備	4,721,300		年金定時払い 源泉			
非準備先残高	657,600		所得税揚げ			
準備預金進捗率	100.0%					
平均	96.8%					
乖離率	3.2%					

8月14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)(8/15~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(8/14~8/15)						
	38,005	38,005	▲0.350	▲0.351		
	432	432	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)
8月10日時点 6,644,800

所要	(億円)
今積期の所要準備額	4,017,300
8月15日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

国債短期証券入札予定

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

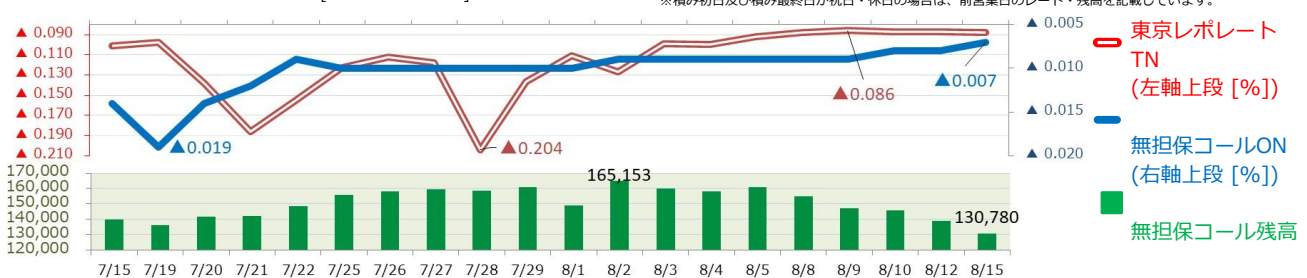
今月の国債買入オペ予定

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