



短期市場の推移

	7月26日	7月27日	7月28日	7月29日
加重平均金利	▲0.010	▲0.010	▲0.010	▲0.010
東京レポレート(TN)	▲0.112	▲0.118	▲0.204	▲0.137
無コール残	158,051	159,401	158,529	161,095
ON	83,103	83,318	82,181	86,977
その他	74,948	76,083	76,348	74,118
有コール残	29,363	29,248	29,111	27,996

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	▲0.040	0.001	▲0.010	▲0.099
T/N	▲0.010	▲0.008	▲0.010	▲0.111
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.010	▲0.007	▲0.009	▲0.136
2W	▲0.035	0.000	▲0.020	▲0.141
3W	-	-	-	▲0.144
1M	▲0.040	0.000	▲0.019	▲0.149
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.148
6M	-	-	-	▲0.149
1Y	-	-	-	▲0.145

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2日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	マネタリーベース (7月)		特になし	
8:50	日銀営業毎旬報告 (7/31現在)		-	
	-		-	

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.007%の出合から始まり、その後は主に▲0.012%~▲0.007%の水準で取引された。ビッドサイドの調達ニーズは先週と変わらず、ON物加重平均金利(速報)も前営業日対比横ばいの▲0.010%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.012 ~ ▲0.010	- ~ -	▲0.012 ~ ▲0.007

翌営業日のマーケット

明日も調達ニーズに変化はなく、出合水準は本日対比横ばいと予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月1日		8月2日		8月3日	
券	+400		+100		+0	
財政	▲19,100		▲17,400		▲85,000	
過不足	▲18,700		▲17,300		▲85,000	
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
国債買入		+11,000				
共通担保(全店)					▲2,300	
CP等買入	▲100					
社債等買入			▲200			
国債補充供給	+9,800	▲7,000	+7,000			
当座預金増減	▲5,000		▲10,500		▲87,300	
当座預金残高	5,402,100		5,391,600		5,304,300	
準備預金残高	4,718,800		主な需給要因			
積み終了先	4,718,800		消費税・法人税・			
超過準備	4,718,600		保険揚げ			
非準備先残高	683,300		国債発行(10年)			
準備預金進捗率	99.9%					
平均	54.8%					
乖離率	45.1%					

8月1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)(8/2~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補充供給(8/1~8/2)						
	6,909	6,909	▲0.350	▲0.350		
	2	2	▲0.500	▲0.500		

マネタリーベース [億円]
7月29日時点 6,659,700

所要	[億円]
今積期の所要準備額	3,870,200
8月2日以降の残り所要	
積数	300
平均	0

国債短期証券入札予定

8月5日	3ヶ月(第1099回)
8月9日	6ヶ月
8月12日	3ヶ月
8月18日	1年

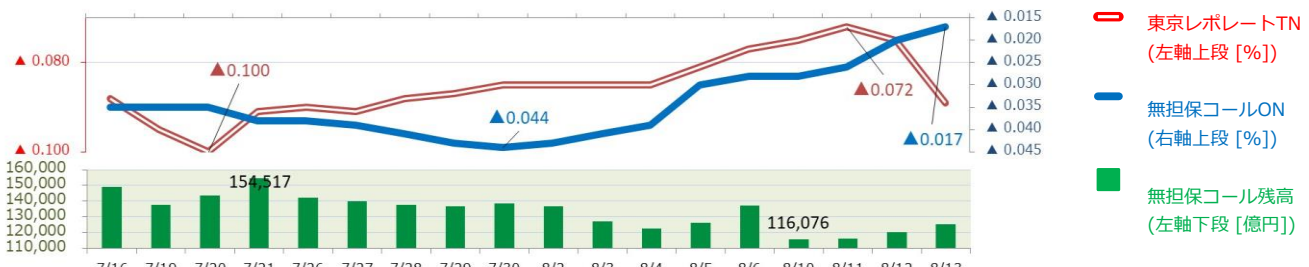
今月の国債買入オペ予定

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6日	1
1年超3年以下	4750	4,750	3 10 17 24	7月25日	4
3年超5年以下	4750	4,750	3 10 24 31	7月29日	4
5年超10年以下	5000	5,000	10 17 24 31	7月29日	4
10年超25年以下	1250	1,250	3 31	7月25日	2
25年超	500	500	17 31	7月29日	2
物価連動債	600	600	月1回	7月29日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	7月13日	0

1年前の市場推移

○2021年7月積み期 [7月16日~8月13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