



デイリーシグナル

2025年8月5日(火)

短期市場の推移

	7月30日	7月31日	8月1日	8月4日
加重平均金利	0.481	0.478	0.477	0.476
東京レポレート(TN)	0.451	0.487	0.492	0.493
無コール残	84,838	80,651	79,237	79,103
ON	33,916	32,439	29,795	29,251
その他	50,922	48,212	49,442	49,852
有コール残	31,067	28,820	34,143	31,074

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	0.450	0.600	0.477	0.490
T/N	-	-	-	0.492
S/N	-	-	-	-
1W	0.481	0.550	0.503	0.482
2W	-	-	-	0.482
3W	-	-	-	0.481
1M	-	-	0.620	0.483
2M	-	-	-	-
3M	0.595	0.700	0.616	0.497
6M	-	-	-	0.529
1Y	-	-	-	0.609

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6日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	毎月勤労統計 (6月)			

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.001%の0.477%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477

翌営業日のマーケット

出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月5日	8月6日	8月6日	8月7日	8月7日	8月7日
券	+600		▲100		+0	
財政	+2,600		▲26,200		+2,000	
過不足		+3,200	▲26,300		+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
共通担保(全店)		▲8,000	▲8,000	+8,000		
国債補充供給	+3,600	▲3,000	+3,000			
当座預金増減		+3,800	▲23,300		+2,000	
当座預金残高		5,204,400	5,181,100		5,183,100	
準備預金残高		4,710,000				
積み終了先		4,709,900				
超過準備		4,709,900				
非準備先残高		494,400				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		67.7%				
乖離率		32.2%				

8月5日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
米ドル資金供給(8/7~8/14)	2	2	4,570	4,570		
国債補充供給(8/5~8/6)	3,039	3,039	0.250	0.250		
共通担保(全店)(8/6~8/20)	8,000	16,895	8,005		47.4	

マネタリーベース [億円]
8月4日時点 6,419,500

所要	今積期の所要準備額
8月6日以降の残り所要	4,121,200
積数	200
平均	0

国庫短期証券入札予定

8月7日	6ヶ月(第1323回)
8月8日	3ヶ月(第1324回)
8月15日	3ヶ月
8月19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	1000	1,000	6	7月2日	1
1年超3年以下	3250	3,250	6 14 20	7月18日	3
3年超5年以下	3250	3,250	6 20 27	7月18日	3
5年超10年以下	3500	3,500	14 20 27	7月28日	3
10年超25年以下	1350	1,350	6 14 27	7月28日	3
25年超	750	750	14 27	7月28日	2
物価連動債	500	500	27	7月28日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-

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