



短期市場の推移

	7月31日	8月1日	8月4日	8月5日
加重平均金利	0.478	0.477	0.476	0.477
東京レボレート(TN)	0.487	0.492	0.493	0.492
無コール残	80,651	79,237	79,103	82,139
ON	32,439	29,795	29,251	32,423
その他	48,212	49,442	49,852	49,716
有コール残	28,820	34,143	31,074	31,146

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	0.450	0.525	0.477	0.492
T/N	-	-	-	0.489
S/N	-	-	-	-
1W	0.481	0.484	0.483	0.482
2W	0.478	0.481	0.478	0.482
3W	-	-	-	0.481
1M	-	-	0.600	0.483
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.496
6M	-	-	-	0.529
1Y	-	-	-	0.609

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7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)	(米) 週間の新規失業保険申請件数	

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)は前営業日対比横ばいの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6日	8月7日	8月7日	8月8日	8月8日
券		+0	▲800	▲1,000	
財政		▲26,000	+3,600	▲7,000	
過不足		▲26,000	+2,800	▲8,000	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入				+8,800	
共通担保(全店)	▲8,000	+8,000			
国債補完供給	+2,800	▲1,400	+1,400		
当座預金増減		▲24,600	+13,000	▲8,000	
当座預金残高		5,179,800	5,192,800	5,184,800	
準備預金残高		4,701,900	主な需給要因		
積み終了先		4,701,800	国債発行(30年)		
超過準備		4,701,800			
非準備先残高		477,900			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		71.0%			
乖離率		28.9%			

8月6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(8/7~)						
~1年	1,000	2,832	1,000	0.019	0.020	87.6
1~3年	3,250	7,242	3,253	0.011	0.012	19.7
3~5年	3,250	9,683	3,254	0.014	0.014	82.5
10~25年	1,350	5,168	1,352	▲0.008	▲0.004	25.5
国債補完供給(8/6~8/7)						
	1,551	1,551	0.250	0.250		
	0	0				

マネタリーベース 【億円】
8月5日時点 6,422,700

所要	【億円】
今積期の所要準備額	4,121,200
8月7日以降の残り所要	
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
国債入札予定	
8月7日	30年
8月13日	5年
8月15日	物価連動
8月19日	20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		0
1年超3年以下	3250	3,250	6	14 20	8月6日 2
3年超5年以下	3250	3,250	6	20 27	8月6日 2
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	8月6日 2
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