



短期市場の推移

[億円] [%]

	7月24日	7月27日	7月28日	7月29日
加重平均金利	0.977	0.978	0.980	0.977
東京レポレート(TN)	1.000	1.000	0.999	0.998
無コール残	99,310	103,678	102,705	99,001
ON	33,196	36,614	36,791	33,857
その他	66,114	67,064	65,914	65,144
有コール残	23,552	24,054	23,544	23,198

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。無担保コール残高は無担保コール残高の重。

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	0.950	1.030	0.979	0.999
T/N	-	-	1.100	0.997
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.984	1.000
2W	-	-	-	1.000
3W	-	-	-	1.000
1M	-	-	1.045	1.002
2M	-	-	1.150	-
3M	-	-	1.270	1.026
6M	-	-	-	1.085
1Y	-	-	-	1.219

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

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	7月30日		7月31日		8月3日	
券	▲100		+300		+0	
財政	▲2,700		▲4,700		▲9,500	
過不足	▲2,800		▲4,400		▲9,500	
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	+4,100		+500			
国債補完供給	+300		▲500		+500	
社債等買入			▲200			
当座預金増減	+1,100		▲4,100		▲9,500	
当座預金残高	4,392,200		4,388,100		4,378,600	
準備預金残高	4,048,700		主な需給要因			
積み終了先	4,047,100		国債発行償還 (2年)			
超過準備	4,047,100		国庫短期証券発行			
非準備先残高	343,500		償還 (3M)			
準備預金進捗率	99.9%					
平均	45.2%					
乖離率	54.7%					

国庫短期証券入札予定

8月6日	6ヶ月(第1398回)
8月7日	3ヶ月
8月14日	3ヶ月
8月19日	1年

国債入札予定

8月4日	10年
8月6日	30年
8月12日	物価連動
8月18日	5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	1,000	1,000	6	23				7月6日	0
1年超3年以下	3,550	3,550	15	23				7月23日	0
3年超5年以下	3,200	3,200	15	29				7月29日	0
5年超10年以下	3,350	3,350	6	23				7月23日	0
10年超25年以下	1,000	1,000	6	23				7月23日	0
25年超	750	750	15	29				7月29日	0
物価連動債	300	300	29					7月29日	0
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

7月31日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
日銀金融政策決定会合 (2日目)			(欧)ユーロ圏消費者物価 (7月)		
8:30	完全失業率 (6月)		-		
8:50	鉱工業生産 (6月)		-		

本日の市況

無担保コールON物は0.977%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。一部金融機関による試し取りが行われたことから、ON物加重平均金利(速報)は前営業対比+0.002%の0.979%となった。

都銀・信託		証券	地銀	
- ~ -		0.977 ~ 0.977	0.977 ~ 0.977	

翌営業日のマーケット

出合いの水準は本日対比横ばい圏を予想する。

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

7月29日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(7/30~7/31)						
	609	609	0.500	0.500		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

7月28日時点 5,587,000

所要

今積期の所要準備額 4,195,400

7月30日以降の残り所要

積数 900

平均 100