



短期市場の推移

[億円] [%]

	7月27日	7月28日	7月29日	7月30日
加重平均金利	0.978	0.980	0.977	0.979
東京レボレート(TN)	1.000	0.999	0.998	0.997
無コール残	103,678	102,705	99,001	99,511
ON	36,614	36,791	33,857	34,797
その他	67,064	65,914	65,144	64,714
有コール残	24,054	23,544	23,198	21,916

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、無担保コール残高は無担保コール残高の値

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	0.940	0.978	0.977	1.000
T/N	-	-	-	1.000
S/N	-	-	-	-
1W	0.981	1.110	1.025	1.000
2W	1.050	1.065	1.062	1.000
3W	-	-	-	1.000
1M	1.030	1.200	1.087	1.002
2M	-	-	1.180	-
3M	-	-	1.280	1.029
6M	-	-	-	1.087
1Y	-	-	-	1.227

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

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	7月31日	8月3日	8月3日	8月4日	8月4日
券		+400		+200	+0
財政		▲11,700		▲82,000	▲59,000
過不足		▲11,300		▲81,800	▲59,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
社債等買入	▲200				
国債補完供給	+500	▲500	+500		
当座預金増減		▲11,500	▲81,300	▲59,000	
当座預金残高		4,380,700	4,299,400	4,240,400	
準備預金残高		4,028,100	主な需給要因		
積み終了先		4,028,000	国債発行償還(2年)	法人税、消費税、	
超過準備		4,028,000	国庫短期証券発行償還(3M)	保険揚げ	
非準備先残高		352,600			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		58.1%			
乖離率		41.8%			

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(第1399回)
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

来月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオペ額	直近オペ額	オペ予定日	直近日	残り回数
1年以下	1,000	1,000	5	7月6日	1
1年超3年以下	7,100	3,550	5 19	7月23日	2
3年超5年以下	6,400	3,200	13 27	7月29日	2
5年超10年以下	6,700	3,350	13 19	7月23日	2
10年超25年以下	2,000	1,000	5 27	7月23日	2
25年超	1,500	750	13 19	7月29日	2
物価連動債	300	300	27	7月29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

8月3日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
13:00	日銀当座預金増減要因と金融調節(7月実績)		(米) 製造業PMI(7月)		
14:00	経済・物価情勢の展望		(米) ISM製造業指数(7月)		
			(欧) ユーロ圏製造業PMI(7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。試し取り要因剥落により、ON物加重平均金利(速報)は前営業対比▲0.002%の0.977%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31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(7/31~8/3)						
	668	668	0.500	0.500		
	2	2	0.500	0.500		

マネタリーベース [億円]

7月30日時点 5,588,100

所要

今積期の所要準備額		4,195,400
8月3日以降の残り所要		
積数		400
平均		0