



短期市場の推移

[億円] [%]

	7月29日	7月30日	7月31日	8月3日
加重平均金利	0.977	0.979	0.977	0.977
東京レボ レート(TN)	0.998	0.997	1.000	1.000
無コール残	99,001	99,511	98,900	105,353
ON	33,857	34,797	34,013	42,209
その他	65,144	64,714	64,887	63,144
有コール残	23,198	21,916	23,251	23,615

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。無有コール残は無担保・有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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボ レート
O/N	0.950	1.030	0.978	1.000
T/N	-	-	-	1.000
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.982	1.000
2W	0.982	1.050	1.015	1.000
3W	-	-	-	1.000
1M	1.040	1.130	1.100	1.002
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	1.051
6M	-	-	-	1.105
1Y	-	-	-	1.247

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
	8月4日	8月5日	8月6日
券	+200	▲300	+0
財政	▲112,700	▲33,500	+0
過不足	▲112,500	▲33,800	+0
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債補完供給	+1,000	+200	エンド
共通担保(全店)	▲200	▲8,000	+8,000
当座預金増減	▲111,700	▲33,600	+0
当座預金残高	4,188,500	4,154,900	4,154,900
準備預金残高	3,857,800	主な需給要因	
積み終了先	3,857,700	国債発行(10年)	
超過準備	3,857,700		
非準備先残高	330,700		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	64.5%		
乖離率	35.4%		

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6日	30年
8月12日	物価連動
8月18日	5年
8月20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	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5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議事要旨 (6月15日・16日開催分)		(米) ADP雇用統計(7月)	
-		(米) クックFRB理事の講演	
-		(欧) PPI(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。ON物加重平均金利(速報)は前営業対比+0.001%の0.978%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\$

8月4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(8/4~8/5)	331	331	0.500	0.500		
共通担保(全店)(8/5~8/19)	8,000	18,088	8,008		44.3	
米ドル資金供給(8/6~8/14)	0	0	3.880	3.880		

マネタリーベース [億円]

8月3日時点 5,495,500

所要

今積期の所要準備額	4,195,400
8月5日以降の残り所要	
積数	200
平均	0