



短期市場の推移

[億円] [%]

	7月30日	7月31日	8月3日	8月4日
加重平均金利	0.979	0.977	0.977	0.978
東京レボレート(TN)	0.997	1.000	1.000	1.000
無コール残	99,511	98,900	105,353	99,715
ON	34,797	34,013	42,209	35,541
その他	64,714	64,887	63,144	64,174
有コール残	21,916	23,251	23,615	23,528

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	0.983	1.055	0.996	1.000
2W	0.984	1.080	1.032	1.000
3W	-	-	-	1.000
1M	-	-	1.040	1.002
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	1.064
6M	-	-	-	1.123
1Y	-	-	-	1.253

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5日	8月6日	8月7日
券	▲200	▲700	▲1,000
財政	▲32,900	+23,700	▲6,000
過不足	▲33,100	+23,000	▲7,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
共通担保	▲8,000	+8,000	
国債補完供給	+200	▲600	+600
国債買入			+5,200
当座預金増減	▲33,500	+28,800	▲7,000
当座預金残高	4,155,000	4,183,800	4,176,800
準備預金残高	3,819,500	主な需給要因	
積み終了先	3,819,500	国債発行(30年)	
超過準備	3,819,500		
非準備先残高	335,500		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	67.7%		
乖離率	32.2%		

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	一回当たりオペファー金額	直近オペファー額	オペファー予定日	直近日	残り回数
1年以下	1,000	1,000	5		8月5日 0
1年超3年以下	7,100	3,550	5 19		8月5日 1
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		8月5日 1
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 -

8月6日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-		(欧) ユーロ圏小売売上高(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)は前営業対比横ばいの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
国債買入(8/6~)						
~1年	1,000	5,497	1,002	0.025	0.028	12.9
1~3年	3,550	11,390	3,552	0.015	0.017	46.1
10~25年	1,000	2,280	1,001	▲0.007	▲0.002	50.0
国債補完供給(8/5~8/6)						
	426	426	0.500	0.500		
	178	178	0.500	0.500		

マネタリーベース [億円]

8月4日時点 5,383,600

所要

今積期の所要準備額	4,195,400
8月6日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

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