



短期市場の推移

[億円] [%]

	7月31日	8月3日	8月4日	8月5日
加重平均金利	0.977	0.977	0.978	0.978
東京レポレート(TN)	1.000	1.000	1.000	1.000
無コール残	98,900	105,353	99,715	101,862
ON	34,013	42,209	35,541	37,338
その他	64,887	63,144	64,174	64,524
有コール残	23,251	23,615	23,528	22,844

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	0.980	1.000
T/N	-	-	-	1.000
S/N	-	-	0.975	-
1W	0.983	1.060	0.996	1.000
2W	-	-	1.115	1.000
3W	-	-	-	1.000
1M	1.060	1.260	1.120	1.002
2M	-	-	-	-
3M	-	-	1.250	1.073
6M	-	-	-	1.139
1Y	-	-	-	1.260

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	
	8月6日	8月7日	8月7日	8月10日	8月10日	8月10日
券		▲600		▲100		▲1,000
財政		+23,500		+4,800		+8,000
過不足		+22,900		+4,700		+7,000
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
国債補完供給	+600	▲700	+700			
国債買入		+5,200				
当座預金増減		+28,000		+5,400		+7,000
当座預金残高		4,183,000		4,188,400		4,195,400
準備預金残高		3,856,100				
積み終了先		3,856,100				
超過準備		3,856,100				
非準備先残高		326,900				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		71.0%				
乖離率		28.9%				

国庫短期証券入札予定

8月7日	3ヶ月(第1399回)
8月14日	3ヶ月
8月19日	1年
8月21日	3ヶ月
国債入札予定	
8月12日	物価連動
8月18日	5年
8月20日	20年
8月24日	10年クライメート・トランジション

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		0
1年超3年以下	7,100	3,550	5 19		1
3年超5年以下	6,400	3,200	13 27		2
5年超10年以下	6,700	3,350	13 19		2
10年超25年以下	2,000	1,000	5 27		1
25年超	1,500	750	13 19		2
物価連動債	300	300	27		1
変動利付債	-	300	-		-

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7日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
15:00	コール市場残高(7月)		(米)雇用統計(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。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0.980%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
国債補完供給(8/6~8/7)						
	746	746	0.500	0.500		
	93	93	0.500	0.500		

マネタリーベース [億円]

8月5日時点 5,350,400

所要

今積期の所要準備額		4,195,400
8月7日以降の残り所要		
積数	100	
平均	0	

[億円]