



短期市場の推移

	7月26日	7月29日	7月30日	7月31日
加重平均金利	0.078	0.077	0.077	0.079
東京レポレート(TN)	0.078	0.074	0.066	0.100
無コール残	74,593	77,626	75,242	76,621
ON	29,381	32,694	30,310	33,926
その他	45,212	44,932	44,932	42,695
有コール残	35,822	36,208	36,077	35,202

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、無コール残は無担保・有担保コール残高の意。
 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	0.215	0.228	0.227	0.166
T/N	-	-	-	0.200
S/N	-	-	-	-
1W	0.228	0.325	0.234	0.186
2W	0.280	0.330	0.317	0.186
3W	-	-	-	0.187
1M	0.300	0.430	0.337	0.189
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.202
6M	-	-	-	0.244
1Y	-	-	-	0.317

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

8月2日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		(米) 雇用統計 (7月)	

本日の市況

無担保コールON物は0.228%の出合から始まり、その後は主に0.225%~0.228%を中心に取引された。本日より日銀当座預金の超過準備に0.25%の付利が適用された。付利金利との裁定を意識したレートに収束し、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比0.148%上昇の0.227%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	0.225 ~ 0.228

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であり、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月1日	8月2日	8月2日	8月5日	8月5日	8月5日
券	+100		+200		+0	
財政	+2,500		▲59,900		+6,000	
過不足	+2,600		▲59,700		+6,000	
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
CP等買入			▲100			
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+23,200	▲29,200	+29,200			
当座預金増減		▲3,400	▲30,700		+6,000	
当座預金残高	5,481,400		5,450,700		5,456,700	
準備預金残高	4,913,200		主な需給要因			
積み終了先	4,913,100		法人税・消費税・保	国庫短期証券発行償		
超過準備	4,913,100		除揚げ	還 (3M)		
非準備先残高	568,200					
準備預金進捗率		99.9%				
平均		54.8%				
乖離率		45.1%				

8月1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(8/1~8/2)	30,046	30,046	▲0.150	▲0.150		
	106	106	▲0.150	▲0.150		

マネタリーベース [億円]
7月31日時点 6,731,200

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,082,100
8月2日以降の残り所要	
積数	700
平均	100

国庫短期証券入札予定

8月2日	3ヶ月(第1247回)
8月8日	6ヶ月(第1248回)
8月9日	3ヶ月
8月16日	3ヶ月

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	1500	1,500	2	7月3日	1
1年超3年以下	3500	3,750	2 7 15 21	7月23日	4
3年超5年以下	3750	4,250	2 7 21 28	7月29日	4
5年超10年以下	4000	4,250	2 15 21 28	7月29日	4
10年超25年以下	1500	1,500	7 15 28	7月29日	3
25年超	750	750	15 28	7月29日	2
物価連動債	600	600	28	7月29日	1
変動利付債	-	300	-	2023/4/14	-

国債入札予定

8月6日	10年
8月8日	30年
8月14日	5年
8月16日	物価連動

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