



短期市場の推移

	7月29日	7月30日	7月31日	8月1日
加重平均金利	0.077	0.077	0.079	0.227
東京レボレート(TN)	0.074	0.006	0.100	0.200
無コール残	77,626	75,242	76,621	71,650
ON	32,694	30,310	33,926	29,553
その他	44,932	44,932	42,695	42,097
有コール残	36,208	36,077	35,202	37,175

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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	0.215	0.228	0.227	0.220
T/N	-	-	-	0.228
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.192
2W	-	-	0.230	0.192
3W	-	-	-	0.191
1M	0.310	0.460	0.361	0.192
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.350	0.203
6M	-	-	-	0.254
1Y	-	-	-	0.332

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

8月5日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
金融政策決定会合議事要旨 (6月13日・14日開催分)		(米) 7月のサービス業PMI (確報)	
		(欧) 7月のサービス業PMI (確報)	

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。ビットサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの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

ビット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2日	8月5日	8月5日	8月6日	8月6日	8月6日
券		+200		+500		+0
財政		▲63,700		+5,900		+0
過不足		▲63,500		+6,400		+0
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
国債買入				+12,900		
CP等買入	▲100		▲500			
社債等買入	▲100					
国債補充供給	+29,200	▲26,000	+26,000			
当座預金増減		▲60,500		+44,800		+0
当座預金残高		5,420,900		5,465,700		5,465,700
準備預金残高		4,852,000				主な需給要因
積み終了先		4,851,900				国庫短期証券発行償還
超過準備		4,851,900		(3M)		
非準備先残高		568,900				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		64.5%				
乖離率		35.4%				

8月2日のオペ結果

オフェ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国債買入(8/5~)	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
~1年	1,500	3,080	1,501	▲0.028	▲0.003	18.4
1~3年	3,500	9,722	3,501	▲0.046	▲0.039	71.6
3~5年	3,750	9,423	3,754	▲0.060	▲0.057	52.7
5~10年	4,000	9,742	4,007	▲0.067	▲0.065	48.5
国債補充供給(8/2~8/5)						
	26,788	26,788	▲0.050	▲0.050		
	38	38	▲0.050	▲0.050		

マナタリーベース 【億円】
8月1日時点 6,727,600

所要	【億円】
今積期の所要準備額	4,082,100
8月5日以降の残り所要	
積数	500
平均	0

国庫短期証券入札予定

8月8日	6ヶ月(第1248回)
8月9日	3ヶ月(第1249回)
8月16日	3ヶ月
8月19日	1年
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

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		8月2日 0
1年超3年以下	3500	3,500	2	7 15 21	8月2日 3
3年超5年以下	3750	3,750	2	7 21 28	8月2日 3
5年超10年以下	4000	4,000	2	15 21 28	8月2日 3
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	-		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