



短期市場の推移

	7月31日	8月1日	8月2日	8月5日
加重平均金利	0.079	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.100	0.200	0.228	0.147
無コール残	76,621	71,650	73,387	82,594
ON	33,926	29,553	30,320	38,807
その他	42,695	42,097	43,067	43,787
有コール残	35,202	37,175	36,979	34,778

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、無有コール残は無担保・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	0.220	0.228	0.227	0.046
T/N	-	-	-	0.115
S/N	-	-	-	-
1W	0.227	0.390	0.249	0.154
2W	-	-	-	0.165
3W	-	-	-	0.172
1M	0.300	0.350	0.319	0.175
2M	-	-	-	-
3M	0.330	0.370	0.365	0.200
6M	-	-	-	0.254
1Y	-	-	-	0.328

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7日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
14:00	6月の景気動向指数(速報)		-	
15:00	7月のコール市場残高		-	
	内田日銀副総裁 金融経済懇談会に出席・会見(函館市)		-	

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。ビッド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6日	8月7日	8月7日	8月8日	8月8日	8月8日
券	+400		+200		+200	
財政	+4,700		▲20,900		+1,000	
過不足		+5,100	▲20,700		+1,200	
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
共通担保(全店)			▲8,000	+8,000		
CP等買入	▲100		▲400			
国債補完供給	+32,200	▲25,400	+25,400			
当座預金増減	+11,800		+4,300		+1,200	
当座預金残高	5,444,200		5,448,500		5,449,700	
準備預金残高	4,861,700		主な需給要因			
積み終了先	4,861,600		国債発行(10年)			
超過準備	4,861,600					
非準備先残高	582,500					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	71.0%					
乖離率	28.9%					

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
米ドル資金供給(8/8~8/15)	0	0	5,540	5,540		
国債補完供給(8/6~8/7)	25,706	25,706	▲0.150	▲0.150		
共通担保(全店)(8/7~8/21)	8,000	8,687	8,004		92.1	

マネタリーベース [億円]
8月5日時点 6,677,900

所要	今積期の所要準備額
8月7日以降の残り所要	4,082,100
積数	400
平均	0

国債短期証券入札予定

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8日	30年
8月14日	5年
8月16日	物価連動
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	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