



短期市場の推移

[億円] [%]

	8月1日	8月4日	8月5日	8月6日
加重平均金利	0.477	0.476	0.477	0.477
東京レボレート(TN)	0.492	0.493	0.492	0.489
無コール残	79,237	79,103	82,139	80,869
ON	29,795	29,251	32,423	30,003
その他	49,442	49,852	49,716	50,866
有コール残	34,143	31,074	31,146	31,315

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	0.450	0.530	0.477	0.491
T/N	-	-	-	0.484
S/N	-	-	-	-
1W	0.480	0.590	0.527	0.482
2W	-	-	0.482	0.482
3W	-	-	-	0.481
1M	-	-	-	0.483
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.590	0.496
6M	-	-	-	0.529
1Y	-	-	-	0.609

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7日		8月8日		8月12日	
券	▲900		▲400		+1,000	
財政	+4,600		+300		+2,000	
過不足	+3,700		▲100		+3,000	
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
国債買入	+8,800					
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+1,400	▲2,300	+2,300			
当座預金増減	+11,600		+2,100		+3,000	
当座預金残高	5,191,400		5,193,500		5,196,500	
準備預金残高	4,728,600		主な需給要因			
積み終了先	4,728,600		国債発行 (30年)		国庫短期証券発行償還 (3M・6M)	
超過準備	4,728,600					
非準備先残高	462,800					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	74.2%					
乖離率	25.7%					

8月7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(8/7~8/8)

2,457 2,457 0.250 0.250
0 0

マネタリーベース [億円]

8月6日時点 6,398,100

所要

[億円]

今積期の所要準備額 4,113,100

8月8日以降の残り所要

積数 100

平均 0

国庫短期証券入札予定

8月8日	3ヶ月(第1324回)
8月15日	3ヶ月
8月19日	1年
8月22日	3ヶ月

国債入札予定

8月13日	5年
8月15日	物価連動
8月19日	20年
8月28日	2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	1000	1,000	6	14	20		8月6日	0
1年超3年以下	3250	3,250	6	14	20		8月6日	2
3年超5年以下	3250	3,250	6	20	27		8月6日	2
5年超10年以下	3500	3,500	14	20	27		7月28日	3
10年超25年以下	1350	1,350	6	14	27		8月6日	2
25年超	750	750	14	27			7月28日	2
物価連動債	500	500	27				7月28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