

デイリーシグナル

2025年8月13日(水)

短期市場の推移

	8月6日	8月7日	8月8日	8月12日
加重平均金利	0.477	0.477	0.477	0.477
東京レボ レート(TN)	0.489	0.484	0.491	0.490
無コール残	80,869	83,532	83,908	82,194
ON	30,003	31,056	31,312	30,568
その他	50,866	52,476	52,596	51,626
有コール残	31,315	33,132	32,841	33,310

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポ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 [%]

[億円] [%] 8月14日の予定 (時刻は日本時間)

日本			海外		
予想			予想		
	-			(米)週間の新規失業保険 申請件数	
	-			(欧) 1-0圖 6月の鉱工業生産	
	-			-	

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	0.450	0.478	0.477	0.487
T/N	-	-	-	0.490
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.484	0.482
2W	0.478	0.550	0.491	0.482
3W	-	-	0.560	0.481
1M	-	-	-	0.484
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.605	0.498
6M	-	-	-	0.530
1Y	-	-	-	0.609

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利（速報）は前営業日対比横ばいの0.477%となった。

【%】		
都銀・信託	証券	地銀
- ～ -	0.477 ～ 0.477	0.477 ～ 0.477

翌営業日のマーケット

出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

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		日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
		8月13日		8月14日		8月15日	
券		+300		▲600		▲1,000	
財政		▲7,000		▲23,000		+78,000	
過不足		▲6,700		▲23,600		+77,000	
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			▲200				
社債等買入			▲200				
国債補充供給	+800	▲600	+600				
当座預金増減		▲6,500		▲23,400		+77,000	
当座預金残高		5,169,900		5,146,500		5,223,500	
準備預金残高		4,717,200		主な需給要因 源泉税揚げ 国債発行（5年） 年金定時払い 国債発行償還（個人）			
積み終了先		4,717,200					
超過準備		4,717,200					
非準預先残高		452,700					
準備預金進捗率		100.0%					
平均		93.5%					
乖離率		6.5%					

8月13日のオペ結果

オベ種類	オフアー	応札	落札	足切	平均	按分
------	------	----	----	----	----	----

国債補完供給(8/13~8/14)	677	677	0.250	0.250
	0	0		

マナタリーベース	所要
8月12日時点 6,396,200	今積期の所要準備額 4,113,100
	8月14日以降の残り所要
	積数 0
	平均 0

国庫短期証券入札予定

8月15日	3ヶ月(第1325回)
8月19日	1年 (第1326回)
8月22日	3ヶ月
8月29日	3ヶ月
国債入札予定	
8月15日	物価連動
8月19日	20年
8月28日	2年
9月2日	10年

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオフア-金額	直近オフア-額	オフア-予定日					直近日	残り回数
1年以下	1000	1,000	6					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、いかなる投資の勧誘行為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市場の正確性、完全性を保証するものでなく、今後予告なく変更されることがあります。

上田八智投資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登)第 243号 加川浩一 日本証券業協会

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