



短期市場の推移

		[億円] [%]			
		8月7日	8月8日	8月12日	8月13日
加重平均金利		0.477	0.477	0.477	0.477
東京レボレート(TN)		0.484	0.491	0.490	0.490
無コール残		83,532	83,908	82,194	81,399
ON		31,056	31,312	30,568	30,373
その他		52,476	52,596	51,626	51,026
有コール残		33,132	32,841	33,310	33,574

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 東京レボレート
	最低	最高	平均	
O/N	0.450	0.525	0.477	0.487
T/N	-	-	-	0.488
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.590	0.482
2W	-	-	0.483	0.482
3W	-	-	-	0.482
1M	-	-	-	0.484
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.700	0.499
6M	-	-	-	0.530
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14日		8月15日		8月18日	
券		▲700		+700		▲1,000	
財政		▲22,300		+76,200		▲1,000	
過不足		▲23,000		+76,900		▲2,000	
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					+8,500		
CP等買入		▲200					
社債等買入		▲200				▲300	
被災地金融機関支援							
国債補充供給		+600	▲500	+500			
当座預金増減		▲23,300		+85,900		▲2,300	
当座預金残高		5,146,600		5,232,500		5,230,200	
準備預金残高		4,701,500		主な需給要因			
積み終了先		4,701,500		年金定時払い		国庫短期証券発行償還 (3M)	
超過準備		4,701,500		国債発行償還 (個人)		国債発行 (物連10年)	
非準備先残高		445,100					
準備預金進捗率		100.0%					
平均		96.8%					
乖離率		3.2%					

8月14日のオペ結果

オペ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国債買入(8/15~)

1~3年	3,250	10,408	3,253	0.021	0.021	98.6
5~10年	3,500	9,322	3,500	0.014	0.014	
10~25年	1,350	4,697	1,354	▲0.002	0.001	45.4
25年~	750	1,645	751	▲0.022	▲0.013	28.0

国債補充供給(8/14~8/15)

640	640	0.250	0.250
0	0		

マネタリーベース [億円]

8月13日時点 6,389,400

所要

[億円]

今積期の所要準備額 4,113,100

8月15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14日	1
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		8月14日	2
10年超25年以下	1350	1,350	6	14	27		8月14日	1
25年超	750	750	14	27			8月14日	1
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