



デイリーシグナル

2025年8月15日(金)

短期市場の推移

	8月8日	8月12日	8月13日	8月14日
加重平均金利	0.477	0.477	0.477	0.477
東京レポレート(TN)	0.491	0.490	0.490	0.488
無コール残	83,908	82,194	81,399	82,133
ON	31,312	30,568	30,373	31,107
その他	52,596	51,626	51,026	51,026
有コール残	32,841	33,310	33,574	34,443

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	0.450	0.478	0.477	0.491
T/N	-	-	-	0.491
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.560	0.482
2W	0.481	0.580	0.506	0.482
3W	-	-	0.620	0.482
1M	-	-	0.610	0.484
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.605	0.500
6M	-	-	-	0.530
1Y	-	-	-	0.609

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18日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
17:00	7月の業態別の日銀当座預金残高		(欧)1-0圏	6月の貿易収支	
	-			-	
	-			-	

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。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月15日	8月18日	8月18日	8月19日	8月19日	8月19日
券	+700		+200		+0	
財政	+73,800		▲4,000		▲4,000	
過不足	+74,500		▲3,800		▲4,000	
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				
被災地金融機関支援			▲300	+100		
国債補完供給	+500	▲400	+400			
当座預金増減	+83,100		▲3,600		▲4,000	
当座預金残高	5,229,700		5,226,100		5,222,100	
準備預金残高	4,781,000		主な需給要因			
積み終了先	4,781,000		国庫短期証券発行償還(3M)			
超過準備	4,781,000		国債発行(物連10年)			
非準備先残高	448,700					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	100.0%					
乖離率	0.0%					

8月15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(8/15~8/18)	488	488	0.250	0.250		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
8月14日時点 6,366,700

所要	[億円]
来積期の所要準備額	4,108,500
8月18日以降の残り所要積数	108,400
平均	3,700

国庫短期証券入札予定

8月19日	1年(第1326回)
8月22日	3ヶ月(第1327回)
8月29日	3ヶ月
9月5日	3ヶ月

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