



短期市場の推移

[億円] [%]

	8月12日	8月13日	8月14日	8月15日
加重平均金利	0.477	0.477	0.477	0.477
東京レボ レート(TN)	0.490	0.490	0.488	0.491
無コール残	82,194	81,399	82,133	80,175
ON	30,568	30,373	31,107	30,499
その他	51,626	51,026	51,026	49,676
有コール残	33,310	33,574	34,443	34,178

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重。

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	0.478	0.477	0.487
T/N	-	-	-	0.490
S/N	-	-	-	-
1W	0.480	0.610	0.543	0.482
2W	-	-	0.481	0.482
3W	-	-	-	0.482
1M	-	-	0.530	0.484
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.620	0.503
6M	-	-	-	0.532
1Y	-	-	-	0.612

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18日	8月19日	8月19日	8月20日	8月20日	8月20日
券		+300	+600		+1,000	
財政		▲1,100	▲4,500		▲8,000	
過不足		▲800	▲3,900		▲7,000	
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
共通担保(全店)					▲8,000	
被災地金融機関支援	▲300	+100				
国債補完供給	+400	▲900	+900			
当座預金増減		▲1,500	▲3,000		▲15,000	
当座預金残高		5,228,200	5,225,200		5,210,200	
準備預金残高		4,779,300				
積み終了先		4,745,600				
超過準備		4,717,900				
非準備先残高		448,900				
準備預金進捗率		98.9%				
平均		9.7%				
乖離率		89.2%				

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
国債入札予定	
8月19日	20年
8月28日	2年
9月2日	10年
9月4日	30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		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