



短期市場の推移

[億円] [%]

	8月13日	8月14日	8月15日	8月18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	0.488	0.491	0.490
無コール残	81,399	82,133	80,175	80,054
ON	30,373	31,107	30,499	29,558
その他	51,026	51,026	49,676	50,496
有コール残	33,574	34,443	34,178	32,881

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	0.493
T/N	-	-	-	0.491
S/N	-	-	-	-
1W	0.484	0.550	0.502	0.482
2W	-	-	-	0.482
3W	-	-	-	0.482
1M	-	-	-	0.484
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.625	0.503
6M	-	-	-	0.533
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19日		8月20日		8月21日	
券		+600		▲600		+1,000
財政		▲3,500		▲2,900		+11,000
過不足		▲2,900		▲3,500		+12,000
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	+8,000		
国債補充供給	+900	▲500	+500			
当座預金増減		▲2,500		▲3,000		+12,000
当座預金残高		5,225,700		5,222,700		5,234,700
準備預金残高		4,778,500				主な需給要因
積み終了先		4,763,800		国庫短期証券発行償還		
超過準備		4,757,800		(1Y)		
非準備先残高		447,200		国債発行 (20年)		
準備預金進捗率		99.4%				
平均		12.9%				
乖離率		86.5%				

国庫短期証券入札予定

8月22日	3ヶ月(第1327回)
8月29日	3ヶ月
9月5日	3ヶ月
9月9日	6ヶ月
国債入札予定	
8月28日	2年
9月2日	10年
9月4日	30年
9月10日	5年

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオペファー金額	直近オペファー額	オペファー予定日	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