



短期市場の推移

[億円] [%]

	8月14日	8月15日	8月18日	8月19日
加重平均金利	0.477	0.477	0.477	0.477
東京レボレート(TN)	0.488	0.491	0.490	0.491
無コール残	82,133	80,175	80,054	81,067
ON	31,107	30,499	29,558	30,621
その他	51,026	49,676	50,496	50,446
有コール残	34,443	34,178	32,881	32,824

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
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	0.450	0.478	0.476	0.492
T/N	-	-	-	0.491
S/N	-	-	-	-
1W	0.470	0.484	0.478	0.483
2W	0.478	0.481	0.478	0.482
3W	-	-	0.550	0.482
1M	-	-	0.525	0.485
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.506
6M	-	-	-	0.535
1Y	-	-	-	0.618

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

8月21日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-		(米) 製造業PMI、サービス業PMI (8月)		
	-		(欧) ユーロ圏製造業PMI、サービス業PMI (8月)		
	-		-		

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▲0.001%の0.476%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。

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月20日	8月21日	8月21日	8月22日	8月22日	8月22日
券	▲700	▲300	▲300	▲300	▲300	+0
財政	▲3,100	+14,800	+14,800	▲7,000	▲7,000	▲7,000
過不足	▲3,800	+14,500	+14,500	▲7,000	▲7,000	▲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
国債買入						
共通担保(全店)	▲8,000	+8,000				
CP等買入			▲100			
国債補完供給	+500	▲200	+200			
当座預金増減	▲3,500	+24,500	+24,500	▲7,000	▲7,000	▲7,000
当座預金残高	5,222,200	5,246,700	5,246,700	5,239,700	5,239,700	5,239,700
準備預金残高	4,773,300	主な需給要因				
積み終了先	4,769,100	流動性供給				
超過準備	4,768,100					
非準備先残高	448,900					
準備預金進捗率	99.5%					
平均	16.1%					
乖離率	83.4%					

8月20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(8/21~)

1~3年	3,250	8,549	3,255	0.008	0.010	52.8
3~5年	3,250	9,363	3,254	0.008	0.008	89.1
5~10年	3,500	9,873	3,500	0.008	0.008	

国債補完供給(8/20~8/21)

308	308	0.250	0.250
0	0		

マネタリーベース [億円]

8月19日時点 6,444,300

所要

[億円]

今積期の所要準備額	4,108,500
8月21日以降の残り所要	
積数	20,000
平均	800

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20日	0
3年超5年以下	3250	3,250	6	20	27		8月20日	1
5年超10年以下	3500	3,500	14	20	27		8月20日	1
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