



短期市場の推移

[億円] [%]

	8月20日	8月21日	8月22日	8月25日
加重平均金利	0.476	0.476	0.476	0.477
東京レボ レート(TN)	0.491	0.491	0.495	0.493
無コール残	81,784	83,503	91,007	90,580
ON	30,658	31,517	40,571	38,794
その他	51,126	51,986	50,436	51,786
有コール残	33,899	32,979	32,621	32,233

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	0.525	0.478	0.490
T/N	-	-	-	0.490
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.485
2W	0.470	0.481	0.476	0.485
3W	-	-	-	0.490
1M	-	-	-	0.490
2M	-	-	-	-
3M	0.600	0.630	0.618	0.520
6M	-	-	-	0.550
1Y	-	-	-	0.670

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26日	8月27日	8月27日	8月28日	8月28日	8月29日
券						
財政						
過不足						
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
CP等買入	▲300					
国債補充供給	+1,000	▲1,300	+1,300			
当座預金増減		▲2,900	▲1,400	▲3,000		
当座預金残高		5,237,400	5,236,000	5,233,000		
準備預金残高		4,791,000				
積み終了先		4,790,500				
超過準備		4,790,100				
非準備先残高		446,400				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		35.5%				
乖離率		64.4%				

8月26日のオペ結果

オペ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

米ドル資金供給(8/28~9/4)

2 2 4.580 4.580

国債補充供給(8/26~8/27)

1,530 1,530 0.250 0.250

0 0

マネタリーベース [億円]

8月25日時点 6,460,100

所要

[億円]

今積期の所要準備額 4,108,500

8月27日以降の残り所要

積数 5,900

平均 300

国庫短期証券入札予定

8月29日	3ヶ月(第1328回)
9月5日	3ヶ月
9月9日	6ヶ月
9月12日	3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	27		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