



短期市場の推移

[億円] [%]

	8月21日	8月22日	8月25日	8月26日
加重平均金利	0.476	0.476	0.477	0.478
東京レボレート(TN)	0.491	0.495	0.493	0.490
無コール残	83,503	91,007	90,580	90,911
ON	31,517	40,571	38,794	39,305
その他	51,986	50,436	51,786	51,606
有コール残	32,979	32,621	32,233	31,771

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	0.525	0.478	0.488
T/N	-	-	-	0.489
S/N	-	-	-	-
1W	0.484	0.530	0.499	0.483
2W	0.471	0.530	0.497	0.482
3W	-	-	-	0.483
1M	0.535	0.560	0.552	0.486
2M	-	-	0.560	-
3M	-	-	0.600	0.524
6M	-	-	-	0.553
1Y	-	-	-	0.661

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27日		8月28日		8月29日	
券	▲200		▲200		+1,800	
財政	▲2,100		▲2,500		▲2,700	
過不足	▲2,300		▲2,700		▲900	
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				+8,800		
国債補充供給	+1,300	▲1,400	+1,400			

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			8月20日	0
3年超5年以下	3250	3,250	6	20	27			8月27日	0
5年超10年以下	3500	3,500	14	20	27			8月27日	0
10年超25年以下	1350	1,350	6	14	27			8月27日	0
25年超	750	750	14	27				8月27日	0
物価連動債	500	500	27					8月27日	0
変動利付債	-	300						4月14日	-

8月28日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
10:30	中川日銀審議委員のあいさつ(山口県)			(米) 4~6月のGDP(2次速報値)	
	-			-	
	-			-	

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0.478%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\$

8月27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(8/28~)						
3~5年	3,250	6,441	3,253	0.002	0.004	78.9
5~10年	3,500	6,309	3,504	▲0.004	0.000	18.0
10~25年	1,350	2,800	1,353	▲0.003	0.004	66.3
25年~	750	2,288	754	0.011	0.011	81.1
物価連動	500	1,479	500	▲0.060	▲0.224	80.0
国債補充供給(8/27~8/28)						
	1,129	1,129	0.250	0.250		
	398	398	0.250	0.250		

マネタリーベース [億円]

8月26日時点 6,456,700

所要

今積期の所要準備額	4,108,500
8月28日以降の残り所要	
積数	5,100
平均	300

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