



短期市場の推移

[億円] [%]

	8月22日	8月25日	8月26日	8月27日
加重平均金利	0.476	0.477	0.478	0.478
東京レポレート(TN)	0.495	0.493	0.490	0.489
無コール残	91,007	90,580	90,911	88,303
ON	40,571	38,794	39,305	35,977
その他	50,436	51,786	51,606	52,326
有コール残	32,621	32,233	31,771	31,658

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポ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)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	0.450	0.530	0.478	0.486
T/N	-	-	-	0.432
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.530	0.468
2W	0.460	0.470	0.465	0.478
3W	-	-	-	0.481
1M	0.540	0.545	0.544	0.485
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.528
6M	-	-	-	0.564
1Y	-	-	-	0.667

無担保コール(速報)は日銀、東京レポ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28日		8月29日		9月1日	
券		▲200		+200		+1,000
財政		▲4,100		+2,000		▲15,000
過不足		▲4,300		+2,200		▲14,000
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		+8,800				
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+1,400	▲800	+800			
成長基盤強化支援					▲5,000	
		</				

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

9月2日	10年
9月4日	30年
9月10日	5年
9月17日	20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29日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:30	7月の完全失業率			(米) 7月のPCE	
8:30	7月の有効求人倍率			(欧) ECB副総裁の講演	
	-			-	

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28日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(8/28~8/29)	888	888	0.250	0.250		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

8月27日時点 6,454,600

所要

今積期の所要準備額		4,108,500
8月29日以降の残り所要		
積数	4,400	
平均	200	

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