



短期市場の推移

[億円] [%]

	8月4日	8月5日	8月6日	8月7日
加重平均金利	0.978	0.978	0.980	0.977
東京レボ レート(TN)	1.000	1.000	1.000	1.000
無コール残	99,715	101,862	102,820	107,167
ON	35,541	37,338	38,186	42,643
その他	64,174	64,524	64,634	64,524
有コール残	23,528	22,844	22,872	23,161

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	0.950	0.978	0.977	0.999
T/N	-	-	-	1.000
S/N	-	-	0.975	-
1W	0.982	1.055	1.006	1.000
2W	-	-	1.060	1.000
3W	-	-	-	1.000
1M	1.075	1.100	1.093	1.002
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	1.091
6M	-	-	-	1.169
1Y	-	-	-	1.269

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10日	8月12日	8月12日	8月13日	8月13日	8月13日
券		▲700	▲200		+500	
財政		+3,400	▲6,100		▲8,000	
過不足		+2,700	▲6,300		▲7,500	
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
国債補完供給	+500	▲300	+300			
当座預金増減		+2,900	▲6,000		▲7,500	
当座預金残高		4,191,400	4,185,400		4,177,900	
準備預金残高		3,860,200				
積み終了先		3,860,200				
超過準備		3,860,200				
非準備先残高		331,200				
準備預金進捗率		100.0%				
平均		87.1%				
乖離率		12.9%				

国庫短期証券入札予定

8月14日	3ヶ月(第1400回)
8月19日	1年
8月21日	3ヶ月
8月28日	3ヶ月
国債入札予定	
8月12日	物価連動
8月18日	5年
8月20日	20年
8月24日	10年プライメート・トランジション

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	1,000	1,000	5		0
1年超3年以下	7,100	3,550	5 19		1
3年超5年以下	6,400	3,200	13 27		2
5年超10年以下	6,700	3,350	13 19		2
10年超25年以下	2,000	1,000	5 27		1
25年超	1,500	750	13 19		2
物価連動債	300	300	27		1
変動利付債	-	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

8月12日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-		(米) 消費者物価(7月)		
	-		-		
	-		-		

本日の市況

無担保コールON物は0.977%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)は前営業対比横ばいの0.977%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.977 ~ 0.977	0.977 ~ 0.977

翌営業日のマーケット

出合い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10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(8/10~8/12)						
	290	290	0.500	0.498		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

8月7日時点 5,384,700

所要

今積期の所要準備額	4,190,300
8月12日以降の残り所要	
積数	0
平均	0