



短期市場の推移

[億円] [%]

	8月5日	8月6日	8月7日	8月10日
加重平均金利	0.978	0.980	0.977	0.977
東京レボ レート(TN)	1.000	1.000	1.000	1.000
無コール残	101,862	102,820	107,167	105,044
ON	37,338	38,186	42,643	39,880
その他	64,524	64,634	64,524	65,164
有コール残	22,844	22,872	23,161	23,747

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	0.950	1.030	0.977	1.000
T/N	-	-	-	1.000
S/N	-	-	0.975	-
1W	0.983	0.985	0.984	1.000
2W	-	-	1.055	1.000
3W	-	-	-	1.000
1M	-	-	1.090	1.003
2M	-	-	-	-
3M	-	-	1.280	1.108
6M	-	-	-	1.183
1Y	-	-	-	1.274

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12日	8月13日	8月14日
券	+0	▲100	+500
財政	▲16,900	▲3,200	+78,000
過不足	▲16,900	▲3,300	+78,500
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債補完供給	+300	+100	スタート
当座預金増減	▲16,700	▲3,200	+78,500
当座預金残高	4,174,700	4,171,500	4,250,000
準備預金残高	3,849,200	主な需給要因	
積み終了先	3,849,200	国債発行(物連10年)	年金定時払い
超過準備	3,849,200	源泉所得税揚げ	
非準備先残高	325,500		
準備預金進捗率	100.0%		
平均	90.3%		
乖離率	9.7%		

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(第1401回)
8月21日	3ヶ月
8月28日	3ヶ月
国債入札予定	
8月18日	5年
8月20日	20年
8月24日	10年クライメート・トランジション
8月28日	2年

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		8月5日 0
1年超3年以下	7,100	3,550	5 19		8月5日 1
3年超5年以下	6,400	3,200	13 27		7月29日 2
5年超10年以下	6,700	3,350	13 19		7月23日 2
10年超25年以下	2,000	1,000	5 27		8月5日 1
25年超	1,500	750	13 19		7月29日 2
物価連動債	300	300	27		7月29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

8月13日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	国内企業物価指数(7月)			(米) PPI(7月)	
	-			(欧) ユーロ圏鉱工業生産(6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12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(8/12~8/13)						
	82	82	0.500	0.500		
	0	0				
米ドル資金供給(8/14~8/20)						
	1	1	3.880	3.880		

マネタリーベース [億円]

8月10日時点 5,388,300

所要

今積期の所要準備額		4,190,300
8月13日以降の残り所要		
積数		0
平均		0

[億円]