



短期市場の推移

[億円] [%]

	8月6日	8月7日	8月10日	8月12日
加重平均金利	0.980	0.977	0.977	0.977
東京レポレート(TN)	1.000	1.000	1.000	1.000
無コール残	102,820	107,167	105,044	100,534
ON	38,186	42,643	39,880	36,060
その他	64,634	64,524	65,164	64,474
有コール残	22,872	23,161	23,747	23,015

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。無担保コール残高は東京証券取引所公表のもの。

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	0.950	0.978	0.977	1.000
T/N	-	-	-	1.000
S/N	-	-	0.975	-
1W	-	-	0.983	1.000
2W	1.050	1.065	1.062	1.000
3W	-	-	-	1.000
1M	-	-	1.105	1.001
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	1.113
6M	-	-	-	1.193
1Y	-	-	-	1.298

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13日	8月14日	8月14日	8月15日	8月17日
券		▲100	+100		▲500
財政		▲3,400	+78,000		▲3,500
過不足		▲3,500	+78,100		▲4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入			+6,800		
国債補完供給	+100	▲500	+500		
当座預金増減		▲3,900	+85,400		▲4,000
当座預金残高		4,170,800	4,256,200		4,252,200
準備預金残高		3,849,100		主な需給要因	
積み終了先		3,849,100		年金定時払い	
超過準備		3,849,100		流動性供給	
非準備先残高		321,700		国債発行償還(個人)	
準備預金進捗率		97.8%		国庫短期証券発行償還(3M)	
平均		93.5%			
乖離率		4.3%			

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年クライマート・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	8月13日	1
5年超10年以下	6,700	3,350	13 19	8月13日	1
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	8月13日	1
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14日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-		(米) 小売売上高(7月)		
	-		(欧) ユーロ圏GDP(4~6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	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13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(8/14~)						
3~5年	3,200	7,953	3,203	0.000	0.004	78.2
5~10年	3,350	8,676	3,353	0.006	0.006	84.0
25年~	750	2,500	752	0.018	0.019	45.1
国債補完供給(8/13~8/14)						
	532	532	0.500	▲0.020		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

8月12日時点 5,371,600

所要

今積期の所要準備額		4,190,300
8月14日以降の残り所要		
積数	0	
平均	0	

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年クライマート・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	8月13日	1
5年超10年以下	6,700	3,350	13 19	8月13日	1
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	8月13日	1
物価連動債	300	300	27	7月29日	1
変動利付債	-	300	-	4月14日	-