



短期市場の推移

[億円] [%]

	8月10日	8月12日	8月13日	8月14日
加重平均金利	0.977	0.977	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	105,044	100,534	98,774	98,368
ON	39,880	36,060	34,030	34,924
その他	65,164	64,474	64,744	63,444
有コール残	23,747	23,015	23,035	22,855

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	0.978	0.977	1.000
T/N	-	-	-	1.000
S/N	-	-	0.970	-
1W	0.983	1.050	1.035	1.000
2W	-	-	1.060	1.000
3W	-	-	-	1.000
1M	-	-	-	1.001
2M	-	-	1.250	-
3M	-	-	1.310	1.131
6M	-	-	-	1.200
1Y	-	-	-	1.318

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17日	8月18日	8月19日
券	+600	+300	+500
財政	▲5,600	▲7,200	▲28,000
過不足	▲5,000	▲6,900	▲27,500
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債補完供給	+200	+1,300	+1,300
被災地金融機関支援		▲100	+100
共通担保(全店)			▲8,000
当座預金増減	▲6,100	▲5,600	▲35,500
当座預金残高	4,250,000	4,244,400	4,208,900
準備預金残高	3,921,400	主な需給要因	
積み終了先	3,608,300	国債発行(5年)	
超過準備	2,967,700		
非準備先残高	328,600		
準備預金進捗率	71.1%		
平均	3.2%		
乖離率	67.9%		

国庫短期証券入札予定

8月19日	1年(第1401回)
8月21日	3ヶ月(第1402回)
8月28日	3ヶ月
9月4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	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18日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-		(米) 鉱工業生産(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14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(8/17~8/18)						
	1,002	1,002	0.500	0.500		
	450	450	0.500	0.500		

マネタリーベース [億円]

8月14日時点 5,452,900

所要

今積期の所要準備額		4,169,900
8月17日以降の残り所要		
積数	274,700	
平均	9,500	