



短期市場の推移

[億円] [%]

	8月19日	8月20日	8月21日	8月24日
加重平均金利	0.977	0.977	0.976	0.977
東京レポレート(TN)	1.000	1.000	1.000	1.000
無コール残	99,043	101,156	101,725	101,107
ON	34,269	36,222	36,651	36,303
その他	64,774	64,934	65,074	64,804
有コール残	23,449	24,213	23,074	23,481

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	0.950	1.025	0.977	1.000
T/N	-	-	-	1.000
S/N	-	-	0.975	-
1W	0.981	1.060	1.017	1.000
2W	-	-	0.983	1.000
3W	-	-	-	1.000
1M	-	-	-	1.013
2M	-	-	-	-
3M	1.350	1.375	1.369	1.160
6M	-	-	-	1.238
1Y	-	-	-	1.420

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25日	8月26日	8月27日
券	+200	▲100	▲500
財政	▲2,900	▲9,300	▲4,500
過不足	▲2,700	▲9,400	▲5,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債補完供給	+200	+200	スタート
社債等買入	▲100		
当座預金増減	▲2,800	▲9,200	▲5,000
当座預金残高	4,248,500	4,239,300	4,234,300
準備預金残高	3,921,200	主な需給要因	
積み終了先	3,921,100	流動性供給	
超過準備	3,919,500		
非準備先残高	327,300		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	32.3%		
乖離率	67.6%		

国庫短期証券入札予定

8月28日	3ヶ月(第1403回)
9月4日	3ヶ月
9月9日	6ヶ月
9月11日	3ヶ月

国債入札予定

8月28日	2年
9月1日	10年
9月3日	30年
9月8日	5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	3,550	3,550	5 19		8月19日 0
3年超5年以下	3,200	3,200	13 27		8月13日 1
5年超10年以下	3,350	3,350	13 19		8月19日 0
10年超25年以下	1,000	1,000	5 27		8月5日 1
25年超	750	750	13 19		8月19日 0
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26日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-		(米) GDP(2Q改訂値)	
-		(米) PCE(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25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(8/25~8/26)

209	209	0.500	0.500
36	36	0.500	0.500

米ドル資金供給(8/27~9/3)

1	1	3.880
---	---	-------

マネタリーベース [億円]

8月24日時点 5,446,800

所要

[億円]

今積期の所要準備額	4,169,900
8月26日以降の残り所要	
積数	1,200
平均	100