



短期市場の推移

	8月2日	8月5日	8月6日	8月7日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.228	0.147	0.115	0.151
無コール残	73,387	82,594	83,441	85,190
ON	30,320	38,807	38,824	40,403
その他	43,067	43,787	44,617	44,787
有コール残	36,979	34,778	36,108	36,491

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意。
 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	0.215	0.229	0.227	0.216
T/N	-	-	-	0.174
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.350	0.162
2W	-	-	0.300	0.167
3W	-	-	-	0.172
1M	-	-	-	0.177
2M	-	-	-	-
3M	0.330	0.730	0.387	0.201
6M	-	-	-	0.257
1Y	-	-	-	0.325

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

8月9日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	7月のマネーストック			-	
	-			-	
	-			-	

本日の市況

無担保コールON物は0.228%の出合から始まり、その後は主に0.225%~0.228%を中心に取引された。ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.227%となった。

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	- ~ -	0.225 ~ 0.228

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛であり、出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月8日	8月9日	8月9日	8月13日	8月13日	8月13日
券		▲500		▲300		+400
財政		▲1,500		▲11,000		+12,000
過不足		▲2,000		▲11,300		+12,400
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
国債買入		+8,400				
CP等買入	▲200		▲700			
国債補完供給	+22,100	▲23,000	+23,000			
当座預金増減		+5,300		+11,000		+12,400
当座預金残高		5,428,400		5,439,400		5,451,800
準備預金残高		4,853,100				
積み終了先		4,853,000				
超過準備		4,853,000				
非準備先残高		575,300				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		77.4%				
乖離率		22.5%				

8月8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(8/8~8/9)	23,471	23,471	▲0.050	▲0.050		
	15	15	▲0.050	▲0.050		

マネタリーベース (億円)
 8月7日時点 6,668,000

所要	(億円)
今積期の所要準備額	4,075,700
8月9日以降の残り所要	
積数	200
平均	0

国庫短期証券入札予定

8月9日	3ヶ月(第1249回)
8月16日	3ヶ月
8月19日	1年
8月23日	3ヶ月
8月14日	5年
8月16日	物価連動
8月20日	20年
8月29日	2年

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオファー金額	直近オファー額	オファー予定日	直近日	残り回数
1年以下	1500	1,500	2		8月2日 0
1年超3年以下	3500	3,500	2 7 15 21		8月7日 2
3年超5年以下	3750	3,750	2 7 21 28		8月7日 2
5年超10年以下	4000	4,000	2 15 21 28		8月2日 3
10年超25年以下	1500	1,500	7 15 28		8月7日 2
25年超	750	750	15 28		7月29日 2
物価連動債	600	600	28		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