



短期市場の推移

	8月5日	8月6日	8月7日	8月8日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.147	0.115	0.151	0.174
無コール残	82,594	83,441	85,190	78,713
ON	38,807	38,824	40,403	33,566
その他	43,787	44,617	44,787	45,147
有コール残	34,778	36,108	36,491	36,303

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	0.200	0.229	0.227	0.182
T/N	-	-	-	0.233
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.175
2W	-	-	-	0.172
3W	-	-	-	0.175
1M	-	-	0.330	0.178
2M	-	-	-	-
3M	0.330	0.350	0.348	0.201
6M	-	-	-	0.255
1Y	-	-	-	0.321

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13日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	7月の企業物価指数		(米)	7月の生産者物価指数	
	-			-	
	-			-	

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。ビット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

ビット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9日	8月13日	8月13日	8月14日	8月14日	8月14日
券		▲300	+0	+200		+200
財政		▲10,500	+6,800	+1,000		+1,000
過不足		▲10,800	+6,800	+1,200		+1,200
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
CP等買入	▲700	▲100				
国債補充供給	+23,000	▲19,000	+19,000			
当座預金増減		▲7,500	+25,700	+1,200		+1,200
当座預金残高		5,420,900	5,446,600	5,447,800		5,447,800
準備預金残高		4,836,300	主な需給要因			
積み終了先		4,836,200	国庫短期証券発行償還			
超過準備		4,836,200	(3M・6M)			
非準備先残高		584,600				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		90.3%				
乖離率		9.6%				

8月9日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(8/9~8/13)						
	19,178	19,178	▲0.050	▲0.050		
	200	200	▲0.050	▲0.050		

マネタリーベース 【億円】
8月8日時点 6,673,800

所要		【億円】
今積期の所要準備額		4,075,700
8月13日以降の残り所要		
積数		100
平均		0

国庫短期証券入札予定

8月16日	3ヶ月(第1250回)
8月19日	1年(第1251回)
8月23日	3ヶ月
8月30日	3ヶ月
国債入札予定	
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