



### 短期市場の推移

	[億円] [%]			
	8月6日	8月7日	8月8日	8月9日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.115	0.151	0.174	0.233
無コール残	83,441	85,190	78,713	77,967
ON	38,824	40,403	33,566	33,430
その他	44,617	44,787	45,147	44,537
有コール残	36,108	36,491	36,303	36,594

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	0.215	0.229	0.227	0.229
T/N	-	-	-	0.224
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.228	0.177
2W	-	-	0.330	0.176
3W	-	-	-	0.177
1M	-	-	-	0.179
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.600	0.200
6M	-	-	-	0.252
1Y	-	-	-	0.317

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14日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-		(米) CPI (7月)		
	-			-	
	-			-	

### 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

	[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15日	
券	+100		+500		+300	
財政	+5,700		+1,100		+59,000	
過不足	+5,800		+1,600		+59,300	
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	▲100		▲200			
国債補充供給	+19,000	▲20,800	+20,800			
当座預金増減	+3,900		+22,200		+59,300	
当座預金残高	5,424,800		5,447,000		5,506,300	
準備預金残高	4,840,500		主な需給要因			
積み終了先	4,840,400		源泉税揚げ			
超過準備	4,840,400		年金定時払い			
非準備先残高	584,300		国債発行(5年)			
準備預金進捗率	100.0%		国債発行償還(個人)			
平均	93.5%					
乖離率	6.5%					

### 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
米ドル資金供給(8/15~8/22)	0	0	5,580	5,580		
国債補充供給(8/13~8/14)	21,152	21,152	▲0.050	▲0.050		
	40	40	▲0.050	▲0.050		

マネタリーベース [億円]  
8月9日時点 6,666,700

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,075,700
8月14日以降の残り所要	
積数	0
平均	0

### 国債短期証券入札予定

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

### 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		0
1年超3年以下	3500	3,500	2	7 15 21	2
3年超5年以下	3750	3,750	2	7 21 28	2
5年超10年以下	4000	4,000	2	15 21 28	3
10年超25年以下	1500	1,500	7	15 28	2
25年超	750	750	15	28	2
物価連動債	600	600	28		1
変動利付債	-	300	-		-

### 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

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