



短期市場の推移

	[億円] [%]			
	8月7日	8月8日	8月9日	8月13日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.151	0.174	0.233	0.224
無コール残	85,190	78,713	77,967	77,897
ON	40,403	33,566	33,430	33,160
その他	44,787	45,147	44,537	44,737
有コール残	36,491	36,303	36,594	36,907

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	0.218	0.290	0.228	0.224
T/N	-	-	-	0.230
S/N	-	-	-	-
1W	0.228	0.390	0.233	0.180
2W	0.320	0.330	0.323	0.181
3W	-	-	-	0.179
1M	-	-	-	0.180
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.350	0.200
6M	-	-	-	0.252
1Y	-	-	-	0.315

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15日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
4~6月の実質GDP (一次速報値)			(米) 鉱工業生産 (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+0.001%の0.228%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

明日は積み最終日であり、ビットサイドの資金調達意欲は引き続き旺盛と見込まれるため、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14日		8月15日		8月16日
券	+500		+200		+200
財政	▲1,600		+54,700		+2,000
過不足	▲1,100		+54,900		+2,200
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
CP等買入	▲200		▲200		
国債補完供給	+20,800	▲18,300	+18,300		
当座預金増減	+1,200		+73,000		+2,200
当座預金残高	5,426,000		5,499,000		5,501,200
準備預金残高	4,848,300		主な需給要因		
積み終了先	4,848,300		源泉税揚げ		
超過準備	4,848,200		年金定時払い		
非準備先残高	577,700		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	96.8%				
乖離率	3.2%				

8月14日のオペ結果

[%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(8/14~8/15)	18,686	18,686	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
 8月13日時点 6,670,500

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,075,700
8月15日以降の残り所要	
積数	0
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16日	物価連動
8月20日	20年
8月29日	2年
9月3日	10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