



短期市場の推移

	8月8日	8月9日	8月13日	8月14日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.228
東京レポレート(TN)	0.174	0.233	0.224	0.230
無コール残	78,713	77,967	77,897	75,597
ON	33,566	33,430	33,160	32,380
その他	45,147	44,537	44,737	43,217
有コール残	36,303	36,594	36,907	36,514

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	0.220	0.228	0.227	0.238
T/N	-	-	-	0.227
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.185
2W	0.281	0.400	0.313	0.182
3W	-	-	-	0.180
1M	-	-	0.290	0.181
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.335	0.200
6M	-	-	-	0.252
1Y	-	-	-	0.314

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16日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
17:00	業態別の日銀当座預金残高 (7月)		(欧) 6月の貿易収支	
	-		-	
	-		-	

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15日	8月16日	8月16日	8月19日	8月19日
券		+200	+700	+100	+100
財政		+56,400	▲400	+3,000	+3,000
過不足		+56,600	+300	+3,100	+3,100
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入				+9,700	
CP等買入	▲200		▲200		
被災地金融機関支援				▲400	+300
国債補完供給	+18,300	▲17,500	+17,500		
当座預金増減		+57,200	+27,300	+3,000	+3,000
当座預金残高		5,483,200	5,510,500	5,513,500	5,513,500
準備預金残高		4,918,600			
積み終了先		4,918,600			
超過準備		4,918,600			
非準備預金残高		564,600			
準備預金進捗率		100.0%			
平均乖離率		100.0%			
		0.0%			

8月15日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(8/16~)						
1~3年	3,500	14,426	3,505	0.002	0.003	76.7
5~10年	4,000	12,150	4,006	0.007	0.008	26.0
10~25年	1,500	4,149	1,509	0.006	0.007	85.7
25年~	750	1,871	751	0.009	0.011	40.0
国債補完供給(8/15~8/16)						
17,841	17,841	▲0.050	▲0.050			
0	0					
被災地金融機関支援 (2024/8/19~2025/8/18)						
279	279					

マナタリーベース (億円)
 8月14日時点 6,671,200

所要	所要
来積期の所要準備額	4,070,500
8月16日以降の残り所要	
積数	4,070,500
平均	131,300

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15日	1
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15日	2
10年超25年以下	1500	1,500	7 15 28	8月15日	1
25年超	750	750	15 28	8月15日	1
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