



短期市場の推移

	8月9日	8月13日	8月14日	8月15日
加重平均金利	0.227	0.227	0.228	0.227
東京レボレート(TN)	0.233	0.224	0.230	0.227
無コール残	77,967	77,897	75,597	73,220
ON	33,430	33,160	32,380	30,833
その他	44,537	44,737	43,217	42,387
有コール残	36,594	36,907	36,514	37,174

加重平均金利、コール残高は日銀、東京レボ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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	0.218	0.228	0.227	0.233
T/N	-	-	-	0.230
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.275	0.186
2W	-	-	-	0.184
3W	-	-	-	0.183
1M	0.290	0.320	0.297	0.184
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.350	0.201
6M	-	-	-	0.253
1Y	-	-	-	0.314

無担保コール(速報)は日銀、東京レボレートは日本証券業協会公表

8月19日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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16日	8月19日	8月19日	8月20日	8月20日
券	+800	+500	+500	+200	+200
財政	+1,100	+4,800	+4,800	+2,000	+2,000
過不足	+1,900	+5,300	+5,300	+2,200	+2,200
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				
被災地金融機関支援			▲400	+300	
国債補完供給	+17,500	▲18,300	+18,300		
当座預金増減	+10,600	+23,500	+23,500	+2,200	+2,200
当座預金残高	5,493,800	5,517,300	5,517,300	5,519,500	5,519,500
準備預金残高	4,931,100				
積み終了先	4,909,000				
超過準備	3,585,900		(3M)	(1Y)	
非準備預金先高	562,700				
準備預金進捗率	99.1%		国債発行(物連10年)		
平均乖離率	9.7%				
乖離率	89.5%				

8月16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
社債等買入(8/21~)	500	1,264	500	0.576	0.613	44.3
国債補完供給(8/16~8/19)	18,624	18,624	▲0.050	▲0.050		
	1	1	▲0.050	▲0.050		

マネタリーベース [億円]
 8月15日時点 6,728,100

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,070,500
8月19日以降の残り所要	
積数	35,000
平均	1,300

国庫短期証券入札予定

8月19日	1年(第1251回)
8月23日	3ヶ月(第1252回)
8月30日	3ヶ月
9月6日	3ヶ月
8月20日	20年
8月29日	2年
9月3日	10年
9月5日	30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