



短期市場の推移

	[億円] [%]			
	8月14日	8月15日	8月16日	8月19日
加重平均金利	0.228	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.230	0.227	0.230	0.223
無コール残	75,597	73,220	71,791	74,665
ON	32,380	30,833	30,614	33,018
その他	43,217	42,387	41,177	41,647
有コール残	36,514	37,174	37,720	36,899

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	0.220	0.228	0.227	0.242
T/N	-	-	-	0.240
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.227	0.190
2W	-	-	-	0.188
3W	-	-	-	0.187
1M	-	-	-	0.188
2M	-	-	0.335	-
3M	-	-	0.350	0.204
6M	-	-	-	0.254
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21日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	7月の貿易収支		(米) FOMC議事録		
			(7月30日・31日開催分)		
	-		-		
	-		-		

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20日	8月21日	8月21日	8月22日	8月22日	8月22日
券	+500	▲100	▲100	+100	+100	+100
財政	+1,800	▲15,300	▲15,300	+1,000	+1,000	+1,000
過不足	+2,300	▲15,400	▲15,400	+1,100	+1,100	+1,100
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
共通担保(全店)			▲8,000	+8,000		
社債等買入				+500		
国債補完供給	+18,000	▲18,700	+18,700			
当座預金増減	+1,600	+3,800	+3,800	+1,100	+1,100	+1,100
当座預金残高	5,496,500	5,500,300	5,500,300	5,501,400	5,501,400	5,501,400
準備預金残高	4,932,800					
積み終了先	4,927,700					
超過準備	4,927,600					
非準備先残高	563,700					
準備預金進捗率	99.6%					
平均	16.1%					
乖離率	83.4%					

8月20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
米ドル資金供給(8/22~8/29)	0	0	5,580	5,580		
国債補完供給(8/20~8/21)	17,801	17,801	▲0.050	▲0.050		
共通担保(全店)(8/21~9/4)	8,000	8,877	8,006		90.2	

マネタリーベース [億円]
 8月19日時点 6,738,700

所要 [億円]	
今積期の所要準備額	4,070,500
8月21日以降の残り所要	
積数	17,800
平均	700

国庫短期証券入札予定

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