



短期市場の推移

	[億円] [%]			
	8月20日	8月21日	8月22日	8月23日
加重平均金利	0.227	0.227	0.227	0.227
東京レポレート(TN)	0.240	0.239	0.229	0.227
無コール残	74,505	76,732	75,956	77,944
ON	32,748	35,095	34,529	36,697
その他	41,757	41,637	41,427	41,247
有コール残	38,467	37,441	37,631	37,178

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	0.239
T/N	-	-	-	0.214
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.193
2W	-	-	-	0.193
3W	-	-	-	0.190
1M	-	-	0.300	0.190
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.204
6M	-	-	-	0.253
1Y	-	-	-	0.316

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27日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
14:00	基調的なインフレ率を補足するための指標 (7月)		(米) 消費者信頼感指数 (8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26日	8月27日	8月27日	8月28日	8月28日
券		+0	+0	+0	+0
財政		+100	+7,000	▲5,000	▲5,000
過不足		+100	+7,000	▲5,000	▲5,000
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	▲100	▲100	▲100		
国債補充供給	+15,300	▲14,800	+14,800		
当座預金増減		+500	+21,700	▲5,000	
当座預金残高		5,505,800	5,527,500	5,522,500	
準備預金残高		4,941,300			主な需給要因
積み終了先		4,940,100			流動性供給
超過準備		4,940,100			
非準備先残高		564,500			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		35.5%			
乖離率		64.4%			

8月26日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(8/26~8/27)	15,172	15,172	▲0.050	▲0.050		
	3	3	▲0.050	▲0.050		

マネタリーベース [億円]
 8月23日時点 6,749,500

所要	[億円]
今積期の所要準備額	4,070,500
8月27日以降の残り所要	
積数	5,300
平均	300

国庫短期証券入札予定

8月30日	3ヶ月(第1253回)
9月6日	3ヶ月
9月9日	6ヶ月
9月13日	3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21日	0
3年超5年以下	3750	3,750	2 7 21 28	8月21日	1
5年超10年以下	4000	4,000	2 15 21 28	8月21日	1
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