



### 短期市場の推移

	7月28日	7月29日	8月1日	8月2日
加重平均金利	▲0.010	▲0.010	▲0.010	▲0.009
東京レポレート(TN)	▲0.204	▲0.137	▲0.111	▲0.127
無コール残	158,529	161,095	149,121	165,153
ON	82,181	86,977	79,033	90,885
その他	76,348	74,118	70,088	74,268
有コール残	29,111	27,996	26,062	27,095

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	▲0.040	0.001	▲0.009	▲0.095
T/N	▲0.010	▲0.008	▲0.010	▲0.099
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.010	▲0.122
2W	▲0.030	▲0.010	▲0.019	▲0.128
3W	-	-	▲0.008	▲0.136
1M	-	-	▲0.030	▲0.141
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.147
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.141

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4日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30	(米)6月貿易収支 -820億米ドル
-	-	21:30	(米)新規失業保険申請件数 [前週分] -
-	-	-	クリーブランド連銀総裁の講演

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.008%の出合から始まり、その後は主に▲0.012%~▲0.008%の水準で取引された。ビッドサイドの調達ニーズは昨日と変わらず、ON物加重平均金利(速報)も前日対比横ばいの▲0.009%であった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.012 ~ ▲0.010	▲0.010 ~ ▲0.010	▲0.010 ~ ▲0.007

### 翌営業日のマーケット

明日も調達ニーズに変化はなく、出合水準は本日対比横ばいと予想する。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月3日		8月4日		8月5日	
券	+500		▲500		+0	
財政	▲79,800		+2,500		+11,000	
過不足	▲79,300		+2,000		+11,000	
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
国庫短期証券買入	+1,000		+12,400		-	
国債買入	-		-		-	
共通担保(全店)	▲2,300	+2,100	-		-	
CP等買入	▲100	-	-		-	
社債等買入	▲200	-	-		-	
国債補充供給	+7,600	▲6,600	+6,600		-	
当座預金増減	▲77,800		+21,000		+11,000	
当座預金残高	5,308,400		5,329,400		5,340,400	
準備預金残高	4,632,400		主な需給要因			
積み終了先	4,632,300		物価連動国債発行			
超過準備	4,632,300		-			
非準備先残高	676,000		-			
準備預金進捗率	99.9%		-			
平均	61.3%		-			
乖離率	38.6%		-			

### 8月3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(固定利回り方式)(8/4~)	-					
5~10年	0	0	-	-	-	-
5~10年	0	0	-	-	-	-
国債買入(8/4~)	-					
~1年	1,500	7,219	1,500	0.016	0.016	68.5
1~3年	4,750	10,193	4,752	0.001	0.005	6.4
3~5年	4,750	13,219	4,756	0.008	0.009	54.3
10~25年	1,250	5,268	1,251	0.025	0.028	44.8
国債補充供給(8/3~8/4)	-					
	6,514	6,514	▲0.350	▲0.350	-	-
	0	0	-	-	-	-

マネタリーベース [億円]  
8月2日時点 6,638,300

所要	所要
今積期の所要準備額	3,870,200
8月4日以降の残り所要	-
積数	200
平均	0

### 国庫短期証券入札予定

8月5日	3ヶ月(第1099回)
8月9日	6ヶ月(第1100回)
8月12日	3ヶ月
8月18日	1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	月1回	8月3日	0
1年超3年以下	4750	4,750	3 10 17 24	8月3日	3
3年超5年以下	4750	4,750	3 10 24 31	8月3日	3
5年超10年以下	5000	5,000	10 17 24 31	7月29日	4
10年超25年以下	1250	1,250	3 31	8月3日	1
25年超	500	500	17 31	7月29日	2
物価連動債	600	600	月1回	7月29日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	7月13日	0

### 1年前の市場推移

○2021年7月積み期 [7月16日~8月13日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



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