



短期市場の推移

	8月1日	8月2日	8月3日	8月4日
加重平均金利	▲0.010	▲0.009	▲0.009	▲0.009
東京レポレート(TN)	▲0.111	▲0.127	▲0.099	▲0.100
無コール残	149,121	165,153	159,980	158,235
ON	79,033	90,885	83,847	82,442
その他	70,088	74,268	76,133	75,793
有コール残	26,062	27,095	29,568	29,158

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	▲0.092
T/N	▲0.010	▲0.008	▲0.010	▲0.092
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.015	0.000	▲0.012	▲0.109
2W	-	-	▲0.015	▲0.120
3W	-	-	-	▲0.131
1M	-	-	-	▲0.137
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.142
6M	-	-	-	▲0.150
1Y	-	-	-	▲0.142

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8日の予定(時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	8:50	6月国際収支(経常収支)	-7109億円	-
	-	-	-	-
	-	-	-	-

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%の合出から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.008%の水準で取引された。ビッドサイドの調達意欲は引き続き強く、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 ~ ▲0.007

翌営業日のマーケット

週末3日積み要因が剥落するものの調達サイドの資金ニーズは強く出合いの水準は横ばい圏と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月5日	8月8日	8月8日	8月9日	8月9日	8月9日
券		+0		+100		+0
財政		+5,400		+3,800		▲3,000
過不足		+5,400		+3,900		▲3,000
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
CP等買入	▲200		▲200			
国債補充供給	+6,200	▲11,300	+11,300			
当座預金増減		+100		+15,000		▲3,000
当座預金残高		5,321,200		5,336,200		5,333,200
準備預金残高		4,660,100		4,660,100		4,660,100
積み終了先		4,660,100		4,660,100		4,660,100
超過準備		4,660,100		4,660,100		4,660,100
非準備先残高		661,100		661,100		661,100
準備預金進捗率		99.9%		99.9%		99.9%
平均		74.2%		74.2%		74.2%
乖離率		25.7%		25.7%		25.7%

8月5日のオペ結果

オベ種類 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)(8/8~)

5~10年 0 0

5~10年 0 0

国債補充供給(8/5~8/8)

11,088 11,088 ▲0.350 ▲0.350

0 0

マネタリーベース (億円)
8月4日時点 6,573,200

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,873,200
8月8日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

国債短期証券入札予定

8月9日	6ヶ月(第1100回)
8月12日	3ヶ月(第1101回)
8月18日	1年
8月19日	3ヶ月

今月の国債買入オペ予定

オベ種類	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

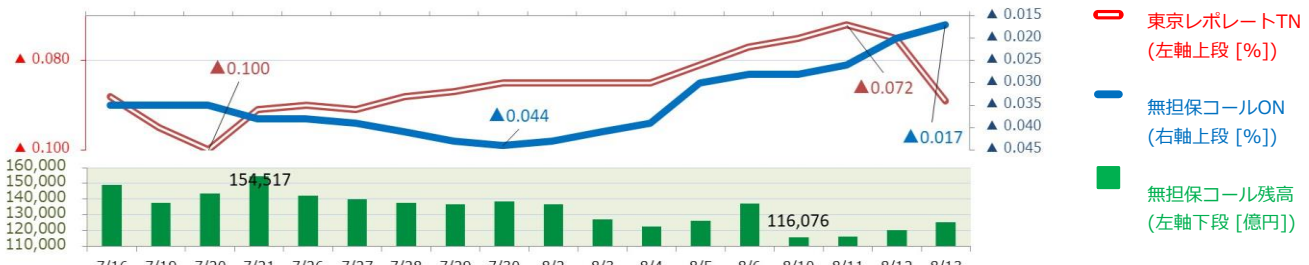
国債入札予定

8月9日	30年
8月16日	5年
8月18日	20年
8月30日	2年

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