



### 短期市場の推移

	8月2日	8月3日	8月4日	8月5日
加重平均金利	▲0.009	▲0.009	▲0.009	▲0.009
東京レボレート(TN)	▲0.127	▲0.099	▲0.100	▲0.092
無コール残	165,153	159,980	158,235	160,814
ON	90,885	83,847	82,442	83,971
その他	74,268	76,133	75,793	76,843
有コール残	27,095	29,568	29,158	29,299

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)			レボ市場
	最低	最高	平均	東京レボレート
O/N	▲0.040	0.001	▲0.009	▲0.089
T/N	▲0.010	▲0.008	▲0.010	▲0.088
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.030	▲0.034	▲0.102
2W	▲0.015	▲0.008	▲0.012	▲0.115
3W	-	-	-	▲0.122
1M	-	-	-	▲0.130
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.134
6M	-	-	-	▲0.149
1Y	-	-	-	▲0.141

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9日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	7月マネーストック(日銀)		21:30 (米)4-6月期非農業部門労働生産速報値[前期比]	-4.5
	-		-	
	-		-	

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▲0.015%~▲0.007%の水準で取引された。3日積み剥落もビッドサイドの調達意欲は底堅く、ON物加重平均金利(速報)は前日対比横ばいの▲0.009%であった。また、本日日本銀行より8月積み期の基準比率が公表され、前積み期対比+7.5%の33.0%であった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.015 ~ ▲0.009	▲0.009 ~ ▲0.008	▲0.010 ~ ▲0.007

### 翌営業日のマーケット

オファー・ビッドサイド共に大きな動向変化は見られず、本日対比横ばいの地合いを予想する。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	8月8日	8月9日	8月9日	8月10日	8月10日
券		+100	▲100	▲2,000	
財政		+4,200	▲3,700	▲20,000	
過不足		+4,300	▲3,800	▲22,000	
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	▲200		▲100		
国債補完供給	+11,300	▲9,900	+9,900		
当座預金増減		+5,500	+6,000	▲22,000	
当座預金残高		5,326,700	5,332,700	5,310,700	
準備預金残高		4,677,800			
積み終了先		4,677,800			
超過準備		4,677,800			
非準備先残高		648,900			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		77.4%			
乖離率		22.5%			

### 8月8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)(8/9~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債補完供給(8/8~8/9)						
	9,739	9,739	▲0.350	▲0.350		
	20	20	▲0.350	▲0.350		

マネタリーベース (億円)  
8月5日時点 6,573,300

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,873,200
8月9日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

### 国庫短期証券入札予定

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
8月9日	30年
8月16日	5年
8月18日	20年
8月30日	2年

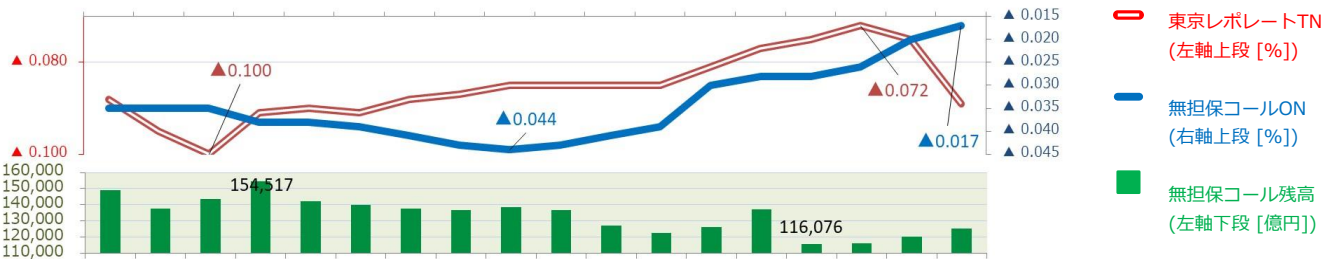
### 今月の国債買入オペ予定

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