



短期市場の推移

	8月4日	8月5日	8月8日	8月9日
加重平均金利	▲0.009	▲0.009	▲0.009	▲0.009
東京レポレート(TN)	▲0.100	▲0.092	▲0.088	▲0.086
無コール残	158,235	160,814	154,958	147,153
ON	82,442	83,971	77,815	70,210
その他	75,793	76,843	77,143	76,943
有コール残	29,158	29,299	28,834	29,142

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

8月12日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	23:00 (米)8月ミシガン大学消費者信頼感指数速報	52.0
-	-	-	-
-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

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	▲0.035	0.001	▲0.008	▲0.086
T/N	-	-	▲0.010	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.009	▲0.099
2W	-	-	▲0.010	▲0.108
3W	-	-	-	▲0.118
1M	-	-	-	▲0.125
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.000	▲0.129
6M	-	-	-	▲0.148
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

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.007%の合出から始まり、その後は主に▲0.010%~▲0.005%の水準で取引された。2日積みということもあり、ON物加重平均金利(速報)は前日対比▲0.001%の▲0.008%であった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.010 ~ ▲0.009	▲0.008 ~ ▲0.008	▲0.010 ~ ▲0.005

翌営業日のマーケット

週末3日積みのため、出合水準は本日対比若干の上昇を予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月10日	8月12日	8月12日	8月15日	8月15日	8月15日
券	▲700	▲400	▲400	+1,000		
財政	▲23,400	▲900	▲900	+69,000		
過不足	▲24,100	▲1,300	▲1,300	+70,000		
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
国債買入				+14,600		
CP等買入	▲800	▲500	▲500			+4,000
国債補完供給	+10,500	▲9,300	+9,300			
当座預金増減	▲23,700	+22,100	+22,100	+74,000		
当座預金残高	5,297,700	5,319,800	5,319,800	5,393,800		
準備預金残高	4,662,700	主な需給要因				
積み終了先	4,662,700	国庫短期証券				
超過準備	4,662,700	発行・償還(3M)				
非準備先残高	635,000	年金定時払い				
準備預金進捗率	100.0%	源泉所得税場上げ				
平均	87.1%					
乖離率	12.9%					

8月10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)(8/12~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(8/12~)						
1~3年	4,750	8,550	4,752	▲0.002	0.000	39.0
3~5年	4,750	14,899	4,753	0.000	0.004	21.4
5~10年	5,000	14,873	5,006	0.001	0.006	16.9
国債補完供給(8/10~8/12)						
	9,177	9,177	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース (億円)
 8月9日時点 6,573,500

所要 (億円)
 今積期の所要準備額 3,873,200
 8月12日以降の残り所要
 積数 0
 平均 0

国庫短期証券入札予定

8月12日	3ヶ月(第1101回)
8月18日	1年(第1102回)
8月19日	3ヶ月
8月26日	3ヶ月

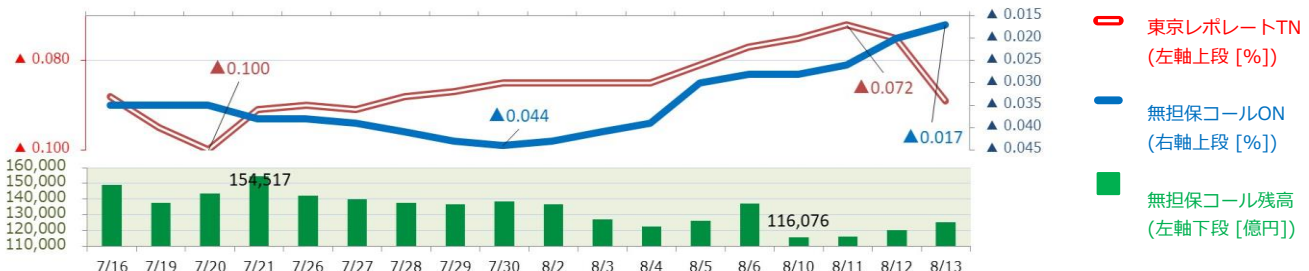
今月の国債買入オペ予定

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10日	2
3年超5年以下	4750	4,750	3 10 24 31	8月10日	2
5年超10年以下	5000	5,000	10 17 24 31	8月10日	3
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
物価運動債	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