



短期市場の推移

[億円] [%]

	8月5日	8月8日	8月9日	8月10日
加重平均金利	▲0.009	▲0.009	▲0.009	▲0.008
東京レボ レート(TN)	▲0.092	▲0.088	▲0.086	▲0.087
無コール残	160,814	154,958	147,153	146,034
ON	83,971	77,815	70,210	71,606
その他	76,843	77,143	76,943	74,428
有コール残	29,299	28,834	29,142	29,178

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	▲0.035	0.001	▲0.008	▲0.087
T/N	-	-	-	▲0.087
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	0.005	▲0.017	▲0.099
2W	▲0.018	0.000	▲0.011	▲0.106
3W	-	-	▲0.020	▲0.113
1M	▲0.028	0.090	▲0.008	▲0.118
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.123
6M	-	-	-	▲0.147
1Y	-	-	-	▲0.140

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

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月12日	8月15日	8月15日	8月16日	8月16日	8月16日
券		▲500		+400		+0
財政		▲3,000		+71,500		▲3,000
過不足		▲3,500		+71,900		▲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
国債買入		+14,600				
CP等買入	▲500		▲300	+4,000		
国債補完供給	+9,300	▲9,800	+9,800			
当座預金増減		+10,100		+85,400		▲3,000
当座預金残高		5,307,800		5,393,200		5,390,200
準備預金残高		4,674,300				主な需給要因
積み終了先		4,674,300				国庫短期証券発行・償還(3M)
超過準備		4,674,300				年金定時払い
非準備先残高		633,500				源泉所得税揚げ
準備預金進捗率		100.0%				
平均		96.8%				
乖離率		3.2%				

国庫短期証券入札予定

8月18日	1年(第1102回)
8月19日	3ヶ月(第1103回)
8月26日	3ヶ月
9月2日	3ヶ月

国債入札予定

8月16日	5年
8月18日	20年
8月30日	2年
9月1日	10年

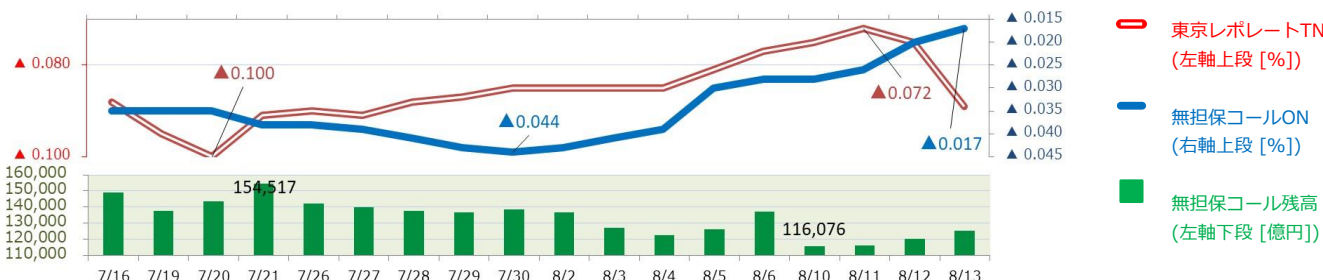
今月の国債買入オペ予定

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