



### 短期市場の推移

	8月9日	8月10日	8月12日	8月15日
加重平均金利	▲0.009	▲0.008	▲0.008	▲0.007
東京レボレート(TN)	▲0.086	▲0.087	▲0.087	▲0.088
無コール残	147,153	146,034	139,031	130,780
ON	70,210	71,606	66,623	62,097
その他	76,943	74,428	72,408	68,683
有コール残	29,142	29,178	29,641	30,595

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	▲0.045	0.001	▲0.018	▲0.086
T/N	-	-	▲0.015	▲0.088
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.015	▲0.030	▲0.096
2W	▲0.025	▲0.007	▲0.014	▲0.101
3W	-	-	-	▲0.107
1M	▲0.030	▲0.014	▲0.019	▲0.114
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.121
6M	-	-	-	▲0.147
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17日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	7月貿易収支	-13863億円	(米)7月26日~27日のFOMC議事録		
	-		-		
	-		-		

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▲0.015%の合出から始まり、その後は主に▲0.020%~▲0.015%の水準で取引された。8月積み期初日の本日は、ビッドサイドが堅調ながらも慎重な動きを見せ、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.011%の▲0.018%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.025 ~ ▲0.015

### 翌営業日のマーケット

ビッドサイドの動きの積極化を見込む。出合いの水準は本日対比で上昇を予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	8月16日	8月17日	8月17日	8月18日	8月18日
券	+300	+100			▲1,000
財政	▲1,800	▲27,500			▲3,000
過不足	▲1,500	▲27,400			▲4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入			+1,000		
共通担保(全店)			▲2,100		+5,000
CP等買入	▲500				
国債補充供給	+10,400	▲10,300	+10,300		
当座預金増減		▲1,900	▲13,200		▲4,000
当座預金残高	5,378,900		5,365,700		5,361,700
準備預金残高	4,692,900				
積み終了先	3,338,200				
超過準備	1,338,000				
非準備先残高	686,000				
準備預金進捗率		86.6%			
平均		3.2%			
乖離率		83.4%			

### 8月16日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国庫短期証券買入(8/17~)	1,000	4,347	1,001	0.026	0.027	85.3
国債買入(固定利回り方式)(8/17~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(8/18~8/25)	1	1	2,580	2,580		
国債補充供給(8/16~8/17)	10,072	10,072	▲0.350	▲0.350		
	0	0				
共通担保(全店)(8/17~8/31)	20,000	4,950	4,950			

マネタリーベース 【億円】  
8月15日時点 6,633,600

所要	【億円】
今積期の所要準備額	3,873,500
8月17日以降の残り所要	
積数	518,600
平均	17,300

### 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

### 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8月積み期 [8月16日~9月15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