



### 短期市場の推移

	8月10日	8月12日	8月15日	8月16日
加重平均金利	▲0.008	▲0.008	▲0.007	▲0.018
東京レポレート(TN)	▲0.087	▲0.087	▲0.088	▲0.088
無コール残	146,034	139,031	130,780	132,874
ON	71,606	66,623	62,097	65,991
その他	74,428	72,408	68,683	66,883
有コール残	29,178	29,641	30,595	30,297

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	▲0.045	0.001	▲0.014	▲0.086
T/N	-	-	▲0.015	▲0.088
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.020	▲0.015	▲0.018	▲0.096
2W	▲0.023	0.160	▲0.010	▲0.100
3W	-	-	▲0.019	▲0.105
1M	▲0.030	0.011	▲0.002	▲0.112
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.121
6M	-	-	-	▲0.146
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

### 8月18日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30	(米)新規失業保険申請件数 [前週分]
-	-	23:00	(米)7月中古住宅販売件数
-	-	-	485万件

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▲0.015%~▲0.010%の水準で取引された。都銀業態を中心に資金調達ニーズが強く、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.004%の▲0.014%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.016 ~ ▲0.015	▲0.015 ~ ▲0.015	▲0.025 ~ ▲0.010

### 翌営業日のマーケット

引き続き都銀業態を中心に資金調達ニーズは強く、合出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17日	8月18日	8月17日	8月18日	8月17日	8月18日
券	+200		▲700		▲1,000	
財政	▲27,400		▲2,400		▲8,000	
過不足	▲27,200		▲3,100		▲9,000	
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
国庫短期証券買入		+1,000				
国債買入				+10,300		
共通担保(全店)	▲2,100	+5,000				
CP等買入			▲100			
被災地金融機関支援					▲2,900	+400
国債補充供給	+10,300	▲8,600	+8,600			
当座預金増減		▲21,600		+15,700		▲11,500
当座預金残高		5,357,300		5,373,000		5,361,500
準備預金残高		4,675,300				
積み終了先		4,615,500				
超過準備		4,212,600				
非準備先残高		682,000				
準備預金進捗率		98.6%				
平均		6.5%				
乖離率		92.1%				

### 8月17日のオペ結果

オペ種類	オフアー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(固定利回り方式)(8/18~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(8/18~)						
1~3年	4,750	9,441	4,752	▲0.002	0.001	5.6
5~10年	5,000	10,661	5,007	0.014	0.014	92.9
25年~	500	1,814	503	▲0.007	▲0.006	50.4
社債等買入(8/22~)						
750	992	751	0.080	0.127	64.0	
国債補充供給(8/17~8/18)						
8,438	8,438	▲0.350	▲0.350			
0	0					

マネタリーベース (億円)  
 8月16日時点 6,631,400

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,873,500
8月18日以降の残り所要	
積数	55,900
平均	1,900

### 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

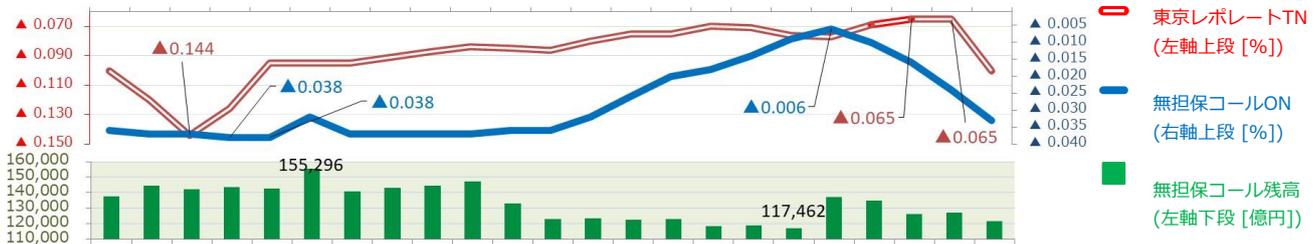
### 今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオフアー金額	直近オフアー額	オフアー予定日	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17日	1
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17日	2
10年超25年以下	1250	1,250	3 31	8月3日	1
25年超	500	500	17 31	8月17日	1
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