



### 短期市場の推移

	8月18日	8月19日	8月22日	8月23日
加重平均金利	▲0.010	▲0.009	▲0.014	▲0.022
東京レポレート(TN)	▲0.088	▲0.088	▲0.088	▲0.092
無コール残	139,120	146,126	139,529	138,874
ON	67,327	71,208	65,936	63,721
その他	71,793	74,918	73,593	75,153
有コール残	30,525	30,608	29,724	29,809

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	▲0.060	0.001	▲0.031	▲0.093
T/N	-	-	▲0.023	▲0.096
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.060	▲0.020	▲0.034	▲0.103
2W	▲0.040	▲0.015	▲0.027	▲0.108
3W	▲0.035	▲0.001	▲0.010	▲0.114
1M	-	-	-	▲0.122
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.129
6M	-	-	-	▲0.146
1Y	-	-	-	▲0.143

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25日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 (米)4-6月期GDP改定値[前期比年率]	-0.9%
-	-	21:30 (米)新規失業保険申請件数[前週分]	-
-	-	-	-

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▲0.020%の合出から始まり、その後は主に▲0.045%~▲0.020%の水準で取引された。昨日に引き続きマーケットの地合は低下基調であり、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.009%の▲0.031%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.040	▲0.040 ~ ▲0.035	▲0.035 ~ ▲0.020

### 翌営業日のマーケット

引き続き地合は低下基調であり、出合水準は低下すると予想する。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月24日	8月25日	8月24日	8月25日	8月24日	8月25日
券	+100		▲1,100		▲1,000	
財政	▲8,100		+40,900		▲8,000	
過不足	▲8,000		+39,800		▲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				+14,700		
CP等買入	▲100		▲100			
社債等買入			▲100			
国債補充供給	+9,100	▲7,400	+7,400			
当座預金増減	▲5,400		+61,700		▲9,000	
当座預金残高	5,342,600		5,404,300		5,395,300	
準備預金残高	4,672,800					
積み終了先	4,671,000					
超過準備	4,670,900					
非準備先残高	669,800					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	29.0%					
乖離率	70.9%					

### 8月24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)(8/25~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
国債買入(8/25~)						
1~3年	4,750	9,176	4,756	▲0.005	▲0.003	64.9
3~5年	4,750	11,501	4,754	0.005	0.007	2.0
5~10年	5,000	10,558	5,011	0.004	0.006	86.2
国債補充供給(8/24~8/25)						
	7,341	7,341	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)  
8月23日時点 6,600,200

所要 (億円)  
今積期の所要準備額 3,873,500  
8月25日以降の残り所要  
積数 4,400  
平均 200

### 国庫短期証券入札予定

8月26日	3ヶ月(第1104回)
9月2日	3ヶ月
9月8日	6ヶ月
9月9日	3ヶ月

### 国債入札予定

8月30日	2年
9月1日	10年
9月6日	30年
9月13日	5年

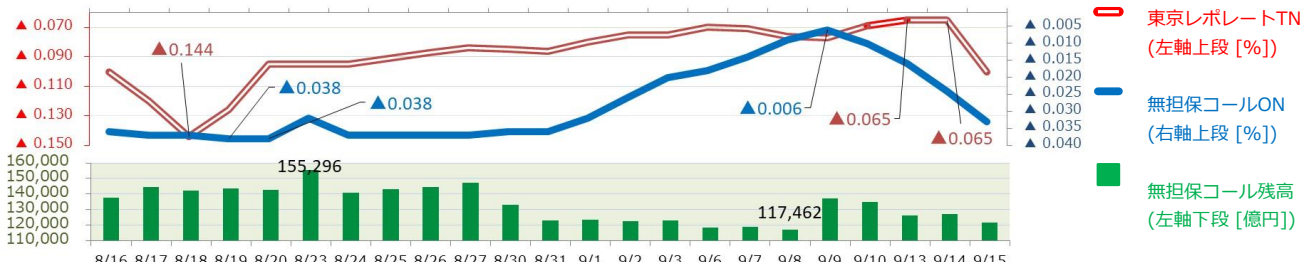
### 今月の国債買入オペ予定

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24日	0
3年超5年以下	4750	4,750	3 10 24 31	8月24日	1
5年超10年以下	5000	5,000	10 17 24 31	8月24日	1
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