



短期市場の推移

	8月22日	8月23日	8月24日	8月25日
加重平均金利	▲0.014	▲0.022	▲0.031	▲0.038
東京レボレート(TN)	▲0.088	▲0.092	▲0.096	▲0.101
無コール残	139,529	138,874	140,177	139,909
ON	65,936	63,721	64,084	62,671
その他	73,593	75,153	76,093	77,238
有コール残	29,724	29,809	30,526	30,147

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	▲0.070	0.001	▲0.039	▲0.093
T/N	▲0.045	▲0.025	▲0.038	▲0.097
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.025	0.005	▲0.019	▲0.104
2W	▲0.040	▲0.002	▲0.031	▲0.111
3W	-	-	-	▲0.118
1M	-	-	-	▲0.125
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.129
6M	-	-	-	▲0.147
1Y	-	-	-	▲0.144

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29日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

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▲0.030%の合出から始まり、その後は主に▲0.055%~▲0.025%の水準で取引された。週末3日積みであったがビッドサイドの積極的な調達は見られず、同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.039%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.045	▲0.040 ~ ▲0.025	▲0.055 ~ ▲0.025

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26日		8月29日		8月30日	
券	▲300		+300		+0	
財政	▲4,100		▲5,300		▲1,000	
過不足	▲4,400		▲5,000		▲1,000	
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
CP等買入	▲900		▲200			
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+7,200	▲6,200	+6,200			
当座預金増減	▲4,300		+900		▲1,000	
当座預金残高	5,391,700		5,392,600		5,391,600	
準備預金残高	4,715,700		4,715,200		主な需給要因	
積み終了先	4,715,200		国庫短期証券			
超過準備	4,715,200		発行・償還(3M)			
非準備先残高	676,000					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	41.9%					
乖離率	58.0%					

8月26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)(8/29~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
CP等買入(8/31~)						
	4,000	11,985	3,985	0.001	0.022	6.5
国債補完供給(8/26~8/29)						
	6,148	6,148	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
 8月25日時点 6,649,300

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,873,500
8月29日以降の残り所要	
積数	2,200
平均	100

国庫短期証券入札予定

9月2日	3ヶ月(第1105回)
9月8日	6ヶ月
9月9日	3ヶ月
9月15日	1年

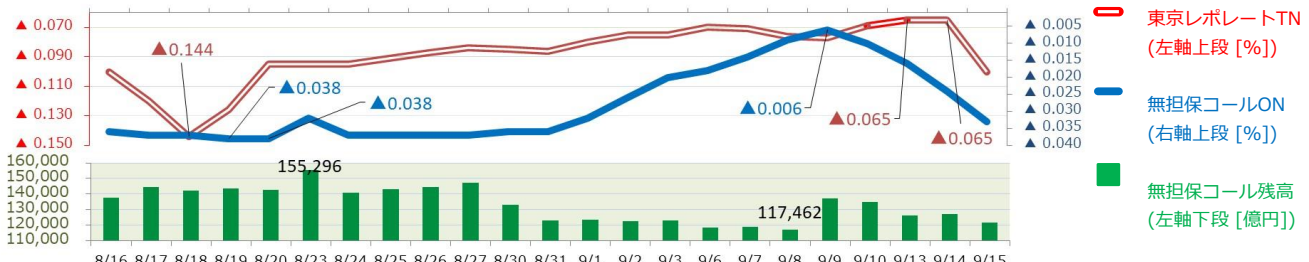
今月の国債買入オペ予定

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