



短期市場の推移

	8月24日	8月25日	8月26日	8月29日
加重平均金利	▲0.031	▲0.038	▲0.039	▲0.039
東京レボレート(TN)	▲0.096	▲0.101	▲0.097	▲0.095
無コール残	140,177	139,909	144,044	144,259
ON	64,084	62,671	65,026	66,031
その他	76,093	77,238	79,018	78,228
有コール残	30,526	30,147	28,354	28,718

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	▲0.065	0.001	▲0.039	▲0.096
T/N	-	-	▲0.026	▲0.105
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.065	▲0.020	▲0.039	▲0.111
2W	▲0.060	▲0.015	▲0.028	▲0.113
3W	-	-	-	▲0.117
1M	-	-	0.000	▲0.128
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.128
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31日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
8:50	7月鉱工業生産指数 [前月比]	▲0.5%	21:15	(米)8月ADP全米雇用報告	-
	-			-	
	-			-	

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▲0.040%の出合から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.030%の水準で取引された。オファー・ビッドの動向に大きな変化は見られず、同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.039%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.048 ~ ▲0.048	▲0.045 ~ ▲0.030	▲0.055 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

オファー・ビッドの動向に大きな変化はなく、出合水準は本日対比横ばいと予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	8月30日	8月31日	8月31日	9月1日	9月1日
券	▲100	+0	▲1,000	▲1,000	
財政	▲3,000	▲5,000	▲22,000	▲22,000	
過不足	▲3,100	▲5,000	▲23,000	▲23,000	
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)			▲5,000	+13,700	
CP等買入	▲700		▲2,400	+4,000	
社債等買入	▲100		▲400		
国債補充供給	+6,100	▲7,900	+7,900		
新型コロナ対応金融支援特別			▲205,000	+11,700	
当座預金増減	▲5,700	▲179,500	▲23,000	▲23,000	
当座預金残高	5,383,200	5,203,700	5,180,700	5,180,700	
準備預金残高	4,706,600	主な需給要因			
積み終了先	4,706,200	国債発行・償還 (2年)			
超過準備	4,706,200				
非準備先残高	676,600				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	48.4%				
乖離率	51.5%				

8月30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(8/31~)	1,000	4,468	1,000	0.021	0.022	90.1
国債買入(固定利回り方式)(8/31~)						
5~10年	0	0				
5~10年	0	0				
米ドル資金供給(9/1~9/8)			0	0	2.590	2.590
国債補充供給(8/30~8/31)	7,746	7,746	▲0.350	▲0.350		
	99	99	▲0.350	▲0.350		
共通担保(全店)(8/31~9/14)	20,000	13,651	13,651			
新型コロナ対応金融支援特別(8/31~2/28)	11,713	11,713				

マネタリーベース (億円)
8月29日時点 6,642,100

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,873,500
8月31日以降の残り所要	
積数	1,300
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
9月1日	10年
9月6日	30年
9月13日	5年
9月15日	20年

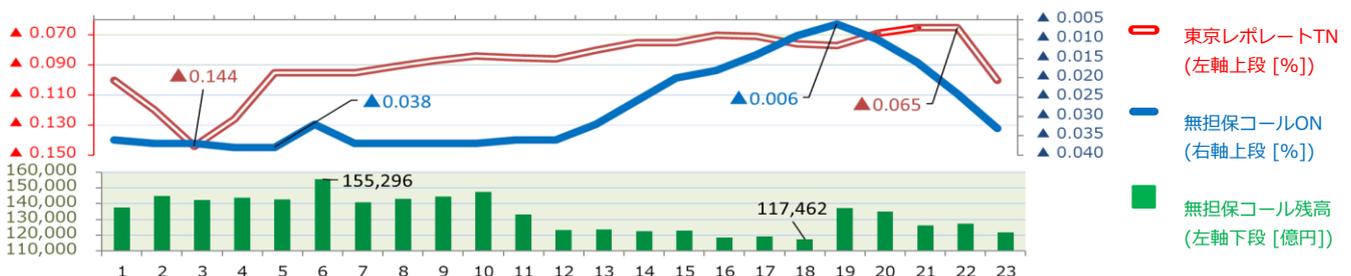
今月の国債買入オペ予定

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