



短期市場の推移

	7月27日	7月28日	7月29日	7月30日
加重平均金利	▲0.039	▲0.041	▲0.043	▲0.044
東京レポレート(TN)	▲0.091	▲0.088	▲0.087	▲0.085
無コール残	140,200	137,520	137,024	138,396
ON	79,924	76,144	76,278	79,515
その他	60,276	61,376	60,746	58,881
有コール残	20,094	20,923	19,534	20,785

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	▲0.070	0.001	▲0.043	▲0.085
T/N	-	-	-	▲0.085
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	▲0.015	▲0.027	▲0.089
2W	▲0.050	▲0.030	▲0.048	▲0.091
3W	-	-	-	▲0.094
1M	▲0.030	0.001	▲0.015	▲0.098
2M	-	-	-	-
3M	-	-	▲0.015	▲0.103
6M	-	-	-	▲0.116
1Y	-	-	-	▲0.130

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3日の予定 (時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:50	7月のマネタリーベース (日銀)		18:00 (欧)6月生産者物価指数[前年比]	-
10:00	7/31現在の営業毎旬報告 (日銀)		-	-
	-	-	-	-

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▲0.070%~▲0.030%の水準で出合が見られた。月末の取引を控えていた先が資金調達を再開したが、影響は限定的だったため出合に大きな変化はなく、同加重平均金利は前日対比+0.001%の▲0.043%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.070 ~ ▲0.060	▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.060 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

ビッドサイドの一部で調達意欲が増進する先も想定され、出合い水準は本日比若干の上昇と予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月2日		8月3日		8月4日	
券		+600		+200		+0
財政		▲15,700		▲15,600		▲85,000
過不足		▲15,100		▲15,400		▲85,000
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
共通担保(全店)					▲4,000	
CP等買入	▲200					
国債補完供給		▲200	+200			
当座預金増減		▲15,500		▲15,200		▲89,000
当座預金残高		5,373,300		5,358,100		5,269,100
準備預金残高		4,701,700	主な需給要因			
積み終了先		4,701,700	税・保険揚げ			
超過準備		4,701,600	国債発行(10年)			
非準備先残高		671,600				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		58.1%				
乖離率		41.8%				

8月2日のオペ結果

【%】(億円)※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(8/2~8/3)	164	164	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
7月30日時点 6,608,800

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,747,800
8月3日以降の残り所要	
積数	200
平均	0

国債短期証券入札予定

8月5日	6ヶ月 第1013回
8月6日	3ヶ月 第1014回
8月13日	3ヶ月
8月19日	1年

国債入札予定

8月3日	10年
8月5日	物価連動
8月11日	30年
8月24日	5年

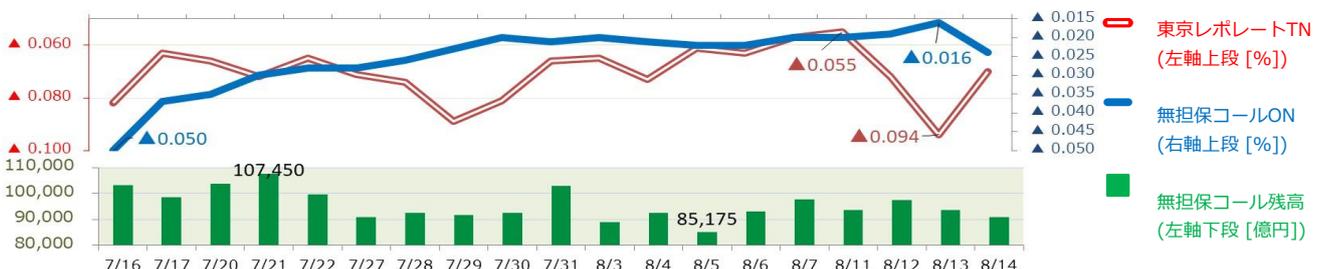
今月の国債買入オペ予定

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回程度	7月28日	1
1年超3年以下	4500	4,500	4 12 18 25	7月21日	4
3年超5年以下	4500	4,500	4 12 18 30	7月28日	4
5年超10年以下	4250	4,250	12 18 25 30	7月28日	4
10年超25年以下	1500	1,500	4	7月2日	1
25年超	500	500	25	7月14日	1
物価連動債	600	600	月1回	7月21日	1
変動利付債<四半期>	300	300	四半期に1回	7月7日	-

1年前の市場推移

○2020年7月積み期 [7月16日~8月14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