



短期市場の推移

	7月29日	7月30日	8月2日	8月3日
加重平均金利	▲0.043	▲0.044	▲0.043	▲0.041
東京レボレート(TN)	▲0.087	▲0.085	▲0.085	▲0.085
無コール残	137,024	138,396	136,620	127,250
ON	76,278	79,515	75,579	64,149
その他	60,746	58,881	61,041	63,101
有コール残	19,534	20,785	19,339	19,719

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	▲0.082
T/N	-	-	▲0.025	▲0.085
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	-	-	0.001	▲0.087
2W	-	-	▲0.040	▲0.089
3W	-	-	-	▲0.093
1M	-	-	▲0.035	▲0.097
2M	-	-	0.015	-
3M	-	-	-	▲0.103
6M	-	-	-	▲0.116
1Y	-	-	-	▲0.130

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5日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 (米)6月貿易収支	-715億米ドル
-	-	20:00 (英)8月英中銀 (BOE) 政策金利	0.1%
-	-	(米)ウォラーFRB理事の講演	-

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▲0.050%~▲0.020%の水準で合出が見られた。前営業日と同様、ビッドサイドの動向に大きな変化はなく、同加重平均金利は前日対比+0.002%の▲0.039%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.050 ~ ▲0.050	▲0.060 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの動向に大きな変化はなく、出合いの水準は横ばい圏を予想する。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	8月4日	8月5日	8月6日
券	+0	▲400	▲1,000
財政	▲79,900	+2,000	▲2,000
過不足	▲79,900	+1,600	▲3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+5,000	-	-
国債買入	-	+10,700	-
共通担保(全店)	▲4,000	+4,000	-
CP等買入	▲100	-	-
社債等買入	▲100	-	-
国債補完供給	+100	-	-
当座預金増減	▲75,000	+12,300	▲3,000
当座預金残高	5,281,200	5,293,500	5,290,500
準備預金残高	4,638,800	-	-
積み終了先	4,638,800	-	-
超過準備	4,638,800	-	-
非準備先残高	642,400	-	-
準備預金進捗率	99.9%	-	-
平均	64.5%	-	-
乖離率	35.4%	-	-

8月4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
------	------	----	----	----	----	----

国債買入(8/5~)						
1~3年	4,500	9,867	4,502	▲0.002	0.000	81.2
3~5年	4,500	9,682	4,505	▲0.005	▲0.003	32.0
10~25年	1,500	3,422	1,514	▲0.003	▲0.003	75.2

国債補完供給(8/4~8/5)						
	37	37	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナリーベース	所要
8月3日時点	6,575,400

所要	所要
今積期の所要準備額	3,747,800
8月5日以降の残り所要	
積数	100
平均	0

国庫短期証券入札予定

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
8月5日	物価連動
8月11日	30年
8月24日	5年
8月26日	20年

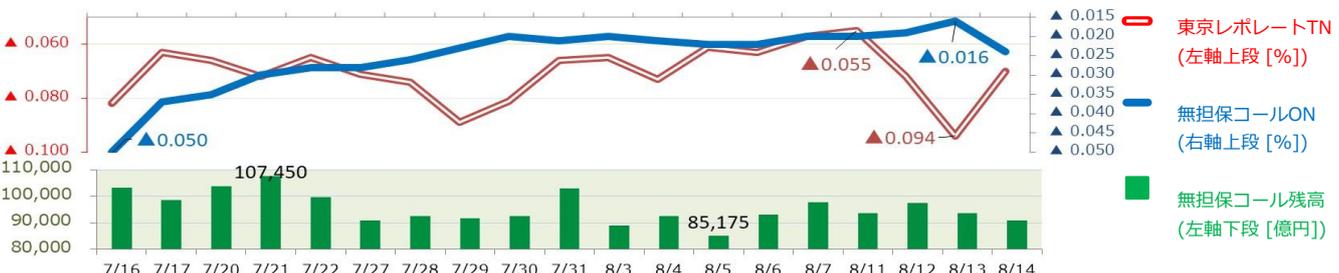
今月の国債買入オペ予定

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	7月28日	1
1年超3年以下	4500	4,500	4 12 18 25	8月4日	3
3年超5年以下	4500	4,500	4 12 18 30	8月4日	3
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 25	8月4日	0
25年超	500	500		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