



短期市場の推移

	8月2日	8月3日	8月4日	8月5日
加重平均金利	▲0.043	▲0.041	▲0.039	▲0.030
東京レポレート(TN)	▲0.085	▲0.085	▲0.085	▲0.081
無コール残	136,620	127,250	122,497	126,188
ON	75,579	64,149	61,466	63,957
その他	61,041	63,101	61,031	62,231
有コール残	19,339	19,719	20,312	20,311

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	▲0.065	0.001	▲0.028	▲0.077
T/N	-	-	▲0.020	▲0.077
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	-	-	-	▲0.081
2W	▲0.040	▲0.003	▲0.037	▲0.086
3W	▲0.033	▲0.030	▲0.032	▲0.091
1M	-	-	-	▲0.097
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲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10日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	8:50	6月国際収支 (経常収支)	7,350億円	(米) クリーブランド連銀 総裁講演
	-		-	
	-		-	

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%の出合から始まり、その後は主に▲0.045%~▲0.015%の水準で出合が見られた。週末4日積みということもあり、都銀・地銀業態の資金調達ニーズが強く、同加重平均金利は前日対比+0.002%の▲0.028%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.045	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.045 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

週初はビッドサイドの様子見姿勢が強く、出合水準は本日と横ばい、もしくは低下を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月6日	8月10日	8月10日	8月11日	8月11日	8月11日
券	+100	+200	+200	+0	+0	+0
財政	+500	+200	+200	▲3,000	▲3,000	▲3,000
過不足	+600	+400	+400	▲3,000	▲3,000	▲3,000
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	▲300	▲300	▲300			
社債等買入						+1,300
国債補完供給		▲100	+100			
当座預金増減	+200	+200	+200	▲1,700	▲1,700	▲1,700
当座預金残高	5,293,100	5,293,300	5,293,300	5,291,600	5,291,600	5,291,600
準備預金残高	4,661,400	4,661,400	4,661,400	4,661,400	4,661,400	4,661,400
積み終了先	4,661,400	4,661,400	4,661,400	4,661,400	4,661,400	4,661,400
超過準備	4,661,400	4,661,400	4,661,400	4,661,400	4,661,400	4,661,400
非準備先残高	631,700	631,700	631,700	631,700	631,700	631,700
準備預金進捗率	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%
平均	80.6%	80.6%	80.6%	80.6%	80.6%	80.6%
乖離率	19.4%	19.4%	19.4%	19.4%	19.4%	19.4%

8月6日のオペ結果

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

オベ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(8/6~8/10)	102	102	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
8月5日時点 6,512,500

所要	今積期の所要準備額	8月10日以降の残り所要
積数	3,741,100	0
平均	0	0

国庫短期証券入札予定

8月13日	3ヶ月 第1015回
8月19日	1年
8月20日	3ヶ月
8月24日	6ヶ月

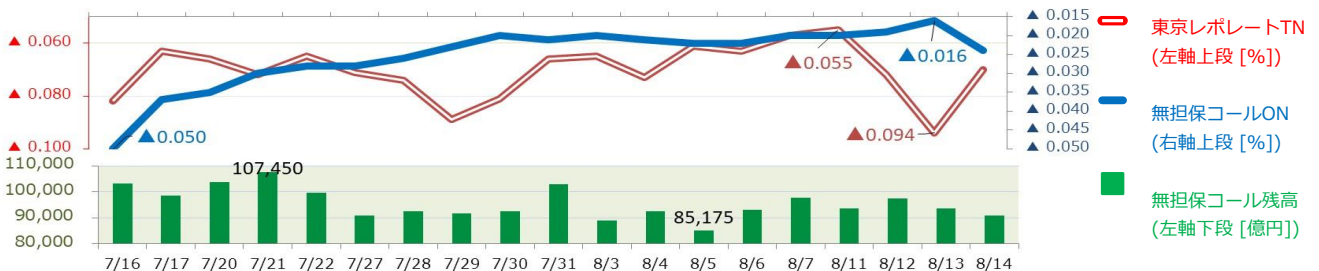
今月の国債買入オペ予定

オベ種類	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	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	8月4日	0
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