



短期市場の推移

	8月4日	8月5日	8月6日	8月10日
加重平均金利	▲0.039	▲0.030	▲0.028	▲0.028
東京レポレート(TN)	▲0.085	▲0.081	▲0.077	▲0.075
無コール残	122,497	126,188	137,060	116,076
ON	61,466	63,957	74,239	55,175
その他	61,031	62,231	62,821	60,901
有コール残	20,312	20,311	20,155	19,998

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	▲0.026	▲0.070
T/N	-	-	-	▲0.072
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.008	▲0.003	▲0.006	▲0.079
2W	▲0.040	▲0.003	▲0.033	▲0.085
3W	-	-	-	▲0.089
1M	-	-	▲0.025	▲0.096
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12日の予定 (時刻は日本時間)

時刻	日本	予想	海外	予想
	8:50	7月国内企業物価指数 [前年比]	-	15:00 (英)6月国内総生産 (GDP) [前月比]
	-	-	21:30 (米)7月生産者物価コア指数[前年比]	5.6%
	-	-	-	-

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▲0.055%~▲0.015%の水準で出合が見られた。昨日同様に地銀業態の資金調達ニーズが強く、同加重平均金利は+0.002%の▲0.026%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.030 ~ ▲0.030	▲0.020 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

地銀業態の調達動向に大きな変化はなく堅調な地合いが継続すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月11日	8月12日	8月12日	8月13日	8月13日	8月13日
券	+200		▲500		▲1,000	
財政	▲2,500		▲8,500		+76,000	
過不足	▲2,300		▲9,000		+75,000	
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
国庫短期証券買入				+7,500		
CP等買入			▲200			
社債等買入		+1,300				
国債補完供給	+400					
当座預金増減	▲600		▲1,700		+75,000	
当座預金残高	5,288,300		5,286,600		5,361,600	
準備預金残高	4,651,500		主な需給要因			
積み終了先	4,651,500		源泉税揚げ		年金定時払い	
超過準備	4,651,500		国債発行(30年)			
非準備先残高	636,800					
準備預金進捗率	100.0%					
平均	87.1%					
乖離率	12.9%					

8月11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(8/12~)	7,500	22,432	7,504	0.002	0.003	83.5
国債補完供給(8/11~8/12)	27	27	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
8月10日時点 6,508,200

所要	今積期の所要準備額
8月12日以降の残り所要	3,741,100
積数	0
平均	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

国債入札予定

8月24日	5年
8月26日	20年
8月31日	2年
9月2日	10年

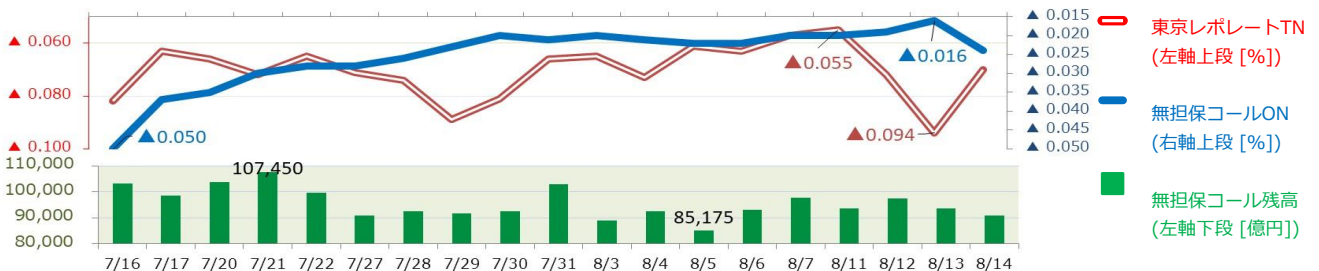
今月の国債買入オペ予定

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	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