



短期市場の推移

	8月10日	8月11日	8月12日	8月13日
加重平均金利	▲0.028	▲0.026	▲0.020	▲0.017
東京レポレート(TN)	▲0.075	▲0.072	▲0.075	▲0.089
無コール残	116,076	116,289	120,263	125,318
ON	55,175	56,748	61,872	68,027
その他	60,901	59,541	58,391	57,291
有コール残	19,998	19,530	19,250	20,197

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	▲0.075	0.001	▲0.036	▲0.097
T/N	-	-	-	▲0.100
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.030	0.010	▲0.016	▲0.099
2W	▲0.055	▲0.008	▲0.039	▲0.099
3W	-	-	-	▲0.102
1M	▲0.015	▲0.001	▲0.010	▲0.104
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.108
6M	-	-	-	▲0.117
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17日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	22:15 (米)7月鉱工業生産指数 [前月比]	0.5%
-	-	(米)パウエルFRB議長 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▲0.025%の出合から始まり、その後は主に▲0.065%~▲0.020%の水準で出合が見られた。積み期間が切り替わったことで取り手が様子見姿勢となり、全体のレートは前営業日比で大きく低下した。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.019%の▲0.036%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.040 ~ ▲0.040	▲0.055 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

ビットサイドの動向に変化はなく、出合水準は本日と横ばいを予想する。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月16日	8月17日	8月17日	8月18日	8月18日	8月19日
券		+600		+500		+0
財政		+3,100		+1,700		+0
過不足		+3,700		+2,200		+0
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					+5,000
社債等買入			▲100			
国債補充供給	+200	▲300	+300			
当座預金増減		+3,400		+2,400		+1,000
当座預金残高		5,377,800		5,380,200		5,381,200
準備預金残高		4,678,400				
積み終了先		3,282,100				
超過準備		1,427,800				
非準備預金先高		699,400				
準備預金進捗率		86.9%				
平均		3.2%				
乖離率		83.7%				

8月16日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(8/16~8/17)	262	262	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
8月13日時点 6,594,000

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,739,200
8月17日以降の残り所要	
積数	488,700
平均	16,300

国庫短期証券入札予定

8月19日	1年	第1016回
8月20日	3ヶ月	第1017回
8月24日	6ヶ月	
8月27日	3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	

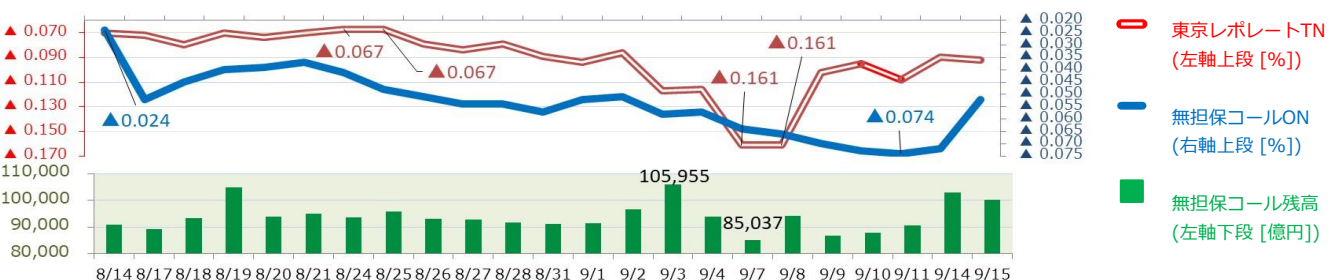
今月の国債買入オペ予定

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12日	2
3年超5年以下	4500	4,500	4 12 18 30	8月12日	2
5年超10年以下	4250	4,250	12 18 25 30	8月12日	3
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	8月12日	-
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8月積み期 [8月14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