



### 短期市場の推移

	8月12日	8月13日	8月16日	8月17日
加重平均金利	▲0.020	▲0.017	▲0.036	▲0.037
東京レボレート(TN)	▲0.075	▲0.089	▲0.100	▲0.120
無コール残	120,263	125,318	137,512	144,756
ON	61,872	68,027	78,149	82,193
その他	58,391	57,291	59,363	62,563
有コール残	19,250	20,197	17,603	17,153

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	▲0.037	▲0.131
T/N	▲0.045	▲0.028	▲0.039	▲0.144
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	-	-	0.001	▲0.119
2W	▲0.038	▲0.030	▲0.035	▲0.116
3W	-	-	-	▲0.114
1M	-	-	-	▲0.115
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.117
6M	-	-	-	▲0.121
1Y	-	-	-	▲0.131

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19日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)8月フィラデルフィア連銀製造業景況指数	24.6
-	-	(米)7月景気先行指数	-
-	-	-	-

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▲0.035%の合出から始まり、その後は主に▲0.055%~▲0.020%の水準で合出が見られた。ビットサイド動向は昨日より大きな変化なく、同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.037%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.063 ~ ▲0.063	- ~ -	▲0.055 ~ ▲0.020

### 翌営業日のマーケット

ビットサイド動向に大きな変化はなく、出合水準は本日と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18日	8月19日	8月19日	8月20日	8月20日
券	+100	▲100	▲100	+1,000	+1,000
財政	▲2,700	+1,700	+1,700	▲23,000	▲23,000
過不足	▲2,600	+1,600	+1,600	▲22,000	▲22,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入	+1,000	-	-	-	-
国債買入	-	+13,400	-	-	-
共通担保(全店)	▲4,000	+3,400	-	-	-
CP等買入	▲100	+5,000	▲200	-	-
国債補充供給	+100	-	-	-	-
当座預金増減	+2,800	+14,800	+14,800	▲22,000	▲22,000
当座預金残高	5,382,800	5,397,600	5,397,600	5,375,600	5,375,600
準備預金残高	4,683,700	-	-	-	-
積み終了先	4,680,600	-	-	-	-
超過準備	4,669,300	-	-	-	-
非準備預金先高	699,100	-	-	-	-
準備預金進捗率	99.8%	-	-	-	-
平均	9.7%	-	-	-	-
乖離率	90.1%	-	-	-	-

### 8月18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(8/19~)

1~3年	4,500	11,060	4,506	▲0.004	▲0.003	38.3
3~5年	4,500	13,593	4,503	▲0.001	0.000	36.8
5~10年	4,250	11,056	4,264	0.001	0.001	79.4

### 国債補充供給(8/18~8/19)

8/18	34	34	▲0.350	▲0.350
8/19	0	0	-	-

マナタリベース	所要
8月17日時点	6,598,500

所要	所要
今積期の所要準備額	3,739,200
8月19日以降の残り所要	-
積数	7,600
平均	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	第1018回
8月27日	3ヶ月	-

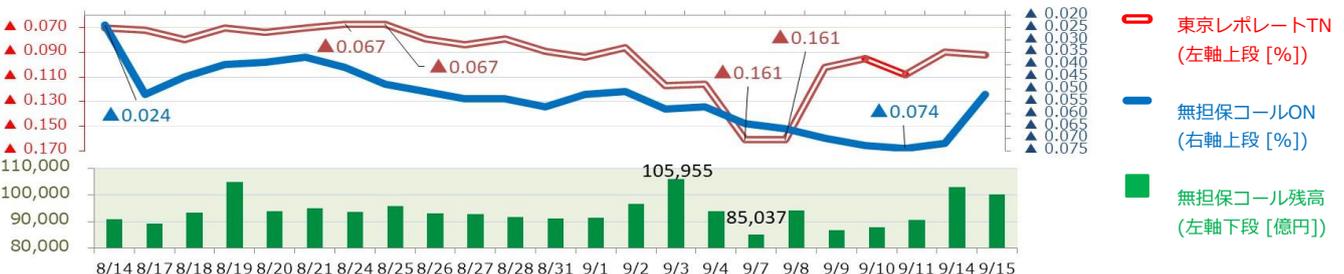
### 今月の国債買入オペ予定

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18日	1
3年超5年以下	4500	4,500	4 12 18 30	8月18日	1
5年超10年以下	4250	4,250	12 18 25 30	8月18日	2
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	0
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