

### 短期市場の推移

	8月17日	8月18日	8月19日	8月20日
加重平均金利	▲0.052	▲0.045	▲0.040	▲0.039
東京レポレート(ON)	▲0.071	▲0.075	▲0.068	▲0.068
無コール残	89,152	93,371	104,804	94,010
ON	61,914	66,113	75,716	64,007
その他	27,238	27,258	29,088	30,003
有コール残	18,596	18,278	18,568	18,358

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。

### 8月24日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
	-		-	
	-		-	
	-		-	

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

### 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	▲0.037	▲0.071
T/N	-	-	▲0.001	▲0.070
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	▲0.071
2W	▲0.033	0.010	▲0.010	▲0.073
3W	-	-	▲0.015	▲0.077
1M	▲0.032	0.010	▲0.022	▲0.082
2M	-	-	0.030	-
3M	-	-	-	▲0.093
6M	-	-	-	▲0.142
1Y	-	-	-	▲0.171

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

### 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.040%の出合から始まり、その後は主に▲0.050%~▲0.030%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.002%の▲0.037%となった。

都銀・信託		証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.050		▲0.045 ~ ▲0.040	▲0.045 ~ ▲0.030

### 翌営業日のマーケット

引き続き地銀を中心に調達ニーズが強く、出合の水準は横ばいから小幅上昇と予想。

### 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	8月21日		8月24日		8月25日
券		▲100		+300	+0
財政		▲12,700		▲12,200	▲28,000
過不足		▲12,800		▲11,900	▲28,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入				+8,800	
共通担保(全店)			▲2,900	+2,800	
CP等買入	▲300		▲300		
社債等買入					+2,000
ETF買入				+300	
被災地金融機関支援	▲900	+2,000			
米ドル用担保国債供給	+1,000				
国債補完供給	+600	▲100	+100		
当座預金増減		▲10,500		▲3,100	▲26,000
当座預金残高		4,514,000		4,510,900	4,484,900
準備預金残高		3,917,900			
積み終了先		3,917,400			
超過準備		3,916,800			
非準備先残高		596,100			
準備預金進捗率		99.9%			
平均		25.8%			
乖離率		74.1%			

### 8月21日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(8/24~)						
1~3年	4,200	12,742	4,205	0.003	0.003	62.7
5~10年	4,200	9,928	4,205	▲0.004	▲0.002	34.3
25年~	300	1,527	306	0.004	0.004	44.9
米ドル資金供給(8/25~9/1)						
			0	0	0.340	0.340
社債等買入(8/25~)						
	2,000	4,716	2,000	0.165	0.181	1.9
国債補完供給(8/21~8/24)						
			111	111	▲0.350	▲0.350
			1	1	▲0.350	▲0.350
共通担保(全店)(8/24~9/7)						
	20,000	2,802	2,802			

マナタリーベース	所要
8月20日時点 5,710,000	今積期の所要準備額 3,499,200
	8月24日以降の残り所要積数 4,400
	平均 200

### 国庫短期証券入札予定

8月24日	6ヶ月	第932回
8月28日	3ヶ月	第933回
9月4日	3ヶ月	
9月9日	6ヶ月	
8月25日	20年	
8月27日	2年	
9月1日	10年	
9月3日	30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	500~1,500	1,000	月3回程度	8月7日	2
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	3 7 13 21 26 31	8月21日	2
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	5 13 19 24 26 31	8月19日	3
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	7 13 19 21 26	8月21日	1
10年超25年以下	500~2,000	1,200	5 28	8月5日	1
25年超	0~500	300	21 28	8月21日	1
物価連動債	300	300	月2回程度	8月3日	1
変動利付債<偶数月>	1,000	1,000	月1回	8月5日	-

### 1年前の市場推移

○2019年8月積み期 [8月16日~9月13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。