

短期市場の推移

	8月18日	8月19日	8月20日	8月21日
加重平均金利	▲0.045	▲0.040	▲0.039	▲0.037
東京レポレート(ON)	▲0.075	▲0.068	▲0.068	▲0.071
無コール残	93,371	104,804	94,010	95,007
ON	66,113	75,716	64,007	64,959
その他	27,258	29,088	30,003	30,048
有コール残	18,278	18,568	18,358	18,174

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25日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
14:00	基調的なインフレ率を捕捉するための指標	17:00	(独)8月IFO企業景況感指数 92.4
-	-	23:00	(米)7月新築住宅販売件数 77.5万戸
-	-	23:00	(米)8月消費者信頼感指数 93.2

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	▲0.041	▲0.069
T/N	-	-	▲0.001	▲0.067
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.038	0.000	▲0.030	▲0.070
2W	▲0.030	0.180	▲0.011	▲0.073
3W	-	-	0.040	▲0.077
1M	-	-	▲0.040	▲0.083
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.091
6M	-	-	-	▲0.139
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▲0.055%~▲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▲0.004%の▲0.041%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.075 ~ ▲0.055	▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.050 ~ ▲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、出合水準は横ばい圏の見込み。

資金需給

	日銀速報 8月24日	日銀予想 8月25日	当社需給予想 8月26日
券	+200	+500	+0
財政	▲17,100	▲31,100	▲10,000
過不足	▲16,900	▲30,600	▲10,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+8,800	+4,500	スタート
共通担保(全店)	▲2,900		
CP等買入	▲300	▲400	
社債等買入		▲100	+2,000
ETF買入	+300		
国債補完供給	+100	▲200	+200
当座預金増減	▲8,300	▲24,400	▲10,000
当座預金残高	4,505,700	4,481,300	4,471,300
準備預金残高	3,936,400	主な需給要因	
積み終了先	3,935,900	国庫短期証券 発行(6M)	国債発行(20 年)
超過準備	3,935,900		
非準預先残高	569,300		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	29.0%		
乖離率	70.9%		

8月24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	接分
国債買入(8/25~)						
~1年	1,000	2,237	1,002	0.009	0.011	34.9
3~5年	3,500	8,980	3,507	▲0.008	▲0.006	26.4
国債補完供給(8/24~8/25)						
		173	173	▲0.350	▲0.350	
		0	0			

マナタリーベース [億円]
8月21日時点 5,699,600

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,499,200
8月25日以降の残り所要
積数 3,900
平均 200

国庫短期証券入札予定

8月28日	3ヶ月	第933回
9月4日	3ヶ月	
9月9日	6ヶ月	
9月11日	3ヶ月	
国債入札予定		
8月25日	20年	
8月27日	2年	
9月1日	10年	
9月3日	30年	

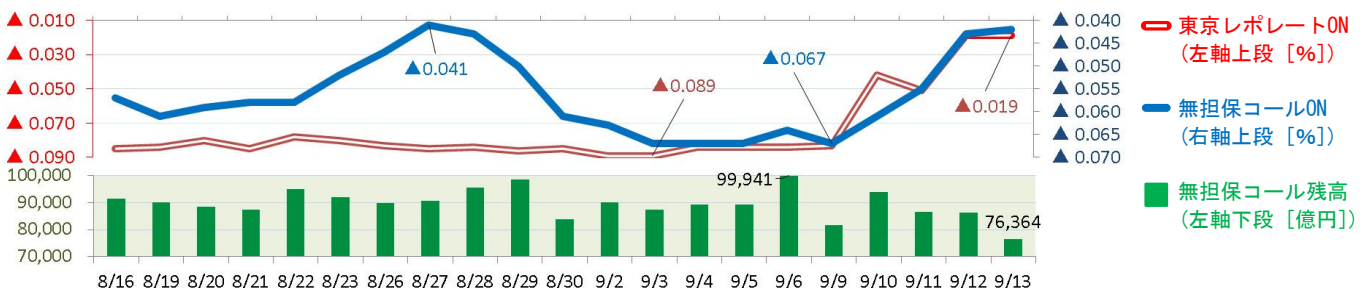
今月の国債買入オペ予定

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24日	1
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24日	2
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	0

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。 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