

短期市場の推移

[億円] [%]

	8月20日	8月21日	8月24日	8月25日
加重平均金利	▲0.039	▲0.037	▲0.041	▲0.048
東京レポレート(ON)	▲0.068	▲0.071	▲0.069	▲0.069
無コール残	94,010	95,007	93,708	95,693
ON	64,007	64,959	61,280	62,515
その他	30,003	30,048	32,428	33,178
有コール残	18,358	18,174	19,328	18,748

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27日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
10:30 【挨拶】鈴木審議委員	-	21:30 (米)4-6月期GDP改定値[前期比年率]	-32.5%
-	-	(米)カンザスシティ連銀主催のジャクソンホール会合	-
-	-	(米)パウエルFRB議長長の講演	-

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	▲0.080	0.001	▲0.051	▲0.076
T/N	-	-	▲0.001	▲0.079
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	▲0.020	▲0.033	▲0.074
2W	-	-	▲0.010	▲0.075
3W	-	-	▲0.045	▲0.078
1M	-	-	-	▲0.082
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.091
6M	-	-	-	▲0.136
1Y	-	-	-	▲0.167

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▲0.045%の出合から始まり、その後は▲0.080%~▲0.030%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は3営業日連続で低下し、前営業日対比▲0.003%の▲0.051%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.070	▲0.055 ~ ▲0.055	▲0.060 ~ ▲0.030

翌営業日のマーケット

出合水準は、本日対比で小幅上昇を予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	8月26日	8月27日	8月28日
券	▲400	▲800	▲1,000
財政	▲4,000	+400	+2,000
過不足	▲4,400	▲400	+1,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		+30,000	スタート
国債買入		+12,200	
CP等買入	▲300	▲300	+6,000
社債等買入		▲200	
ETF買入		+400	
新型コロナ対応金融支援特別貸出増加支援		▲17,300	+133,500
米ドル資金供給用担保国債供給		▲100	+900
当座預金増減	▲4,700	+157,800	+7,900
当座預金残高	4,476,900	4,634,700	4,642,600
準備預金残高	3,890,700	主な需給要因	
積み終了先	3,890,300		
超過準備	3,890,300		
非準備先残高	586,200		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	35.5%		
乖離率	64.4%		

8月26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
国庫短期証券買入(8/27~)	30,000	73,200	30,000	0.003	0.006	2.9
国債買入(8/27~)						
1~3年	4,200	8,265	4,203	▲0.005	0.002	53.9
3~5年	3,500	10,201	3,505	0.007	0.008	5.5
5~10年	4,200	10,778	4,206	0.009	0.011	39.6
CP等買入(8/28~)	6,000	9,802	5,977	▲0.028	▲0.023	56.3
国債補充供給(8/26~8/27)						
	0	0				
	0	0				
新型コロナ対応金融支援特別(8/27~2/26)	133,538	133,538				

マネタリーベース [億円]
8月25日時点 5,666,700

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,499,200
8月27日以降の残り所要
積数 3,100
平均 200

国庫短期証券入札予定

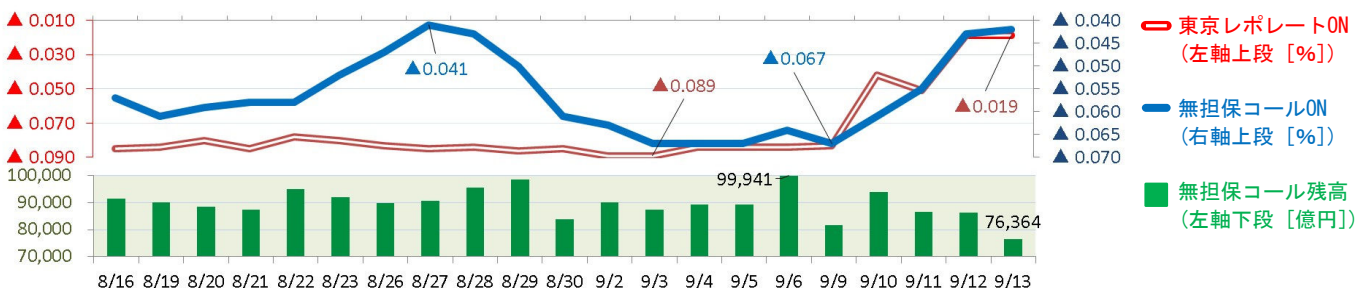
8月28日	3ヶ月	第933回
9月4日	3ヶ月	
9月9日	6ヶ月	
9月11日	3ヶ月	
国債入札予定		
8月27日	2年	
9月1日	10年	
9月3日	30年	
9月8日	5年	

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26日	1
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	5 13 19 24 26 31	8月26日	1
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	7 13 19 21 26	8月26日	0
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。