

短期市場の推移

[億円] [%]

	8月25日	8月26日	8月27日	8月28日
加重平均金利	▲0.048	▲0.051	▲0.054	▲0.054
東京レポレート(ON)	▲0.069	▲0.076	▲0.077	▲0.080
無コール残	95,693	92,953	92,894	91,731
ON	62,515	59,475	58,761	57,798
その他	33,178	33,478	34,133	33,933
有コール残	18,748	18,589	19,141	19,032

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	▲0.087	0.001	▲0.057	▲0.084
T/N	-	-	▲0.001	▲0.089
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	0.000	▲0.020	▲0.084
2W	▲0.040	▲0.010	▲0.027	▲0.083
3W	-	-	▲0.030	▲0.084
1M	-	-	▲0.029	▲0.088
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.095
6M	-	-	-	▲0.137
1Y	-	-	-	▲0.164

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

9月1日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
8:30	7月有効求人倍率	1.08倍	23:00	(米)8月ISM製造業景況指数
8:30	7月失業率	+3.0%	-	-
	-	-	-	-

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▲0.045%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)は前営業日対比▲0.003%の▲0.057%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

引き続き地銀中心の出合となり、出合水準は概ね横ばいを予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	8月31日	9月1日	9月2日
券	+200	+600	+1,000
財政	▲5,400	▲32,600	▲47,000
過不足	▲5,200	▲32,000	▲46,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+2,100	+8,800	スタート
CP等買入	▲2,900	▲100	-
国債補完供給	▲200	+200	-
成長基盤強化支援	-	-	▲4,400 +1,800
当座預金増減	▲6,200	▲23,100	▲48,600
当座預金残高	4,642,200	4,619,100	4,570,500
準備預金残高	4,020,300	主な需給要因	
積み終了先	4,020,200	国債発行・償還(2年)	
超過準備	4,020,000	国債発行(10年)	
非準備先残高	621,900	税保険揚げ	
準備預金進捗率	99.9%	普通交付税	
平均	51.6%	交付金	
乖離率	48.3%		

8月31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(9/1~)						
~1年	1,000	2,528	1,007	0.010	0.010	78.2
1~3年	4,200	12,629	4,204	0.000	0.001	34.3
3~5年	3,500	9,989	3,508	0.000	0.001	67.9
国債補完供給(8/31~9/1)						
	154	154	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース[億円] 所要[億円]
8月28日時点 5,835,100 今積期の所要準備額 3,499,200

9月1日以降の残高	所要
積数	700
平均	0

国庫短期証券入札予定

9月4日	3ヶ月	第934回
9月9日	6ヶ月	
9月11日	3ヶ月	
9月16日	1年	
国債入札予定		
9月1日	10年	
9月3日	30年	
9月8日	5年	
9月10日	20年	

来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31日	3
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	2 7 11 16 23 28	8月31日	6
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	2 7 11 16 23 30	8月31日	6
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	4 11 16 23 28	8月26日	5
10年超25年以下	500~2,000	1,200	2 14	8月28日	2
25年超	0~500	300	7 28	8月28日	2
物価連動債	300	300	月2回程度	8月28日	2
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。