



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	▲0.037	▲0.037	▲0.038	▲0.038
東京レボレート(TN)	▲0.120	▲0.144	▲0.126	▲0.095
無コール残	144,756	142,261	143,688	142,704
ON	82,193	78,058	76,615	77,131
その他	62,563	64,203	67,073	65,573
有コール残	17,153	16,112	16,554	20,393

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	▲0.032	▲0.094
T/N	-	-	▲0.028	▲0.095
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.038	▲0.025	▲0.029	▲0.097
2W	▲0.040	▲0.003	▲0.037	▲0.099
3W	-	-	-	▲0.102
1M	▲0.025	▲0.020	▲0.023	▲0.105
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.113
6M	-	-	-	▲0.121
1Y	-	-	-	▲0.130

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24日の予定 (時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-		23:00	(米)7月新築住宅販売件数	70.0万戸
	-			-	
	-			-	

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▲0.065%~▲0.020%の水準で合出が見られた。本日は大規模な試し取りが行われたことにより、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.006%の▲0.032%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.065	▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.060 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

引き続き放出サイド・調達サイドに大きな変化はなく、出合いの水準は横ばいと予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月23日		8月24日		8月25日	
券		+100		▲200		+1,000
財政		+10,000		+300		▲26,000
過不足		+10,100		+100		▲25,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
CP等買入	▲200		▲200			
社債等買入				+800		
当座預金増減		+9,900		+700		▲25,000
当座預金残高		5,384,000		5,384,700		5,359,700
準備預金残高		4,686,700	主な需給要因			
積み終了先		4,686,400	国債発行(5年)			
超過準備		4,686,400	国庫短期証券			
非準備先残高		697,300	発行・償還(6M)			
準備預金進捗率		99.9%				
平均		25.8%				
乖離率		74.1%				

8月23日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補完供給(8/23~8/24)	44	44	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース

8月20日時点	所要
6,592,500	今積期の所要準備額 3,739,200
	8月24日以降の残り所要
	積数 3,600
	平均 200

国債短期証券入札予定

8月24日	6ヶ月	第1018回
8月27日	3ヶ月	第1019回
9月3日	3ヶ月	
9月9日	6ヶ月	

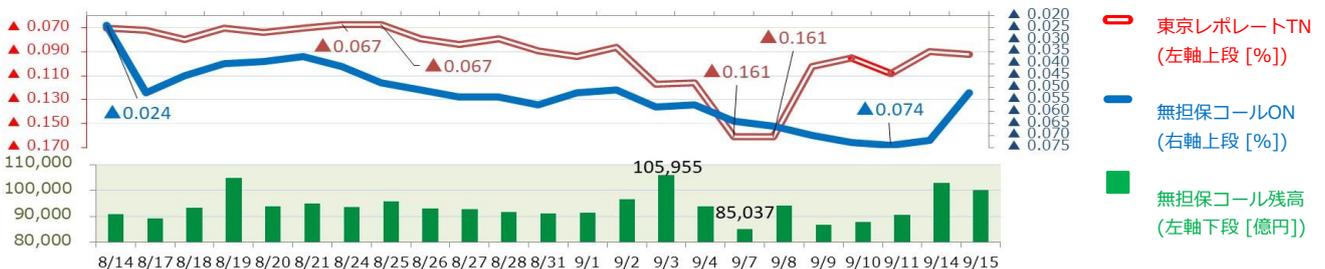
今月の国債買入オペ予定

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