



短期市場の推移

	8月19日	8月20日	8月23日	8月24日
加重平均金利	▲0.038	▲0.038	▲0.032	▲0.037
東京レボレート(TN)	▲0.126	▲0.095	▲0.095	▲0.095
無コール残	143,688	142,704	155,296	140,715
ON	76,615	77,131	92,683	77,492
その他	67,073	65,573	62,613	63,223
有コール残	16,554	20,393	16,558	16,564

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	▲0.037	▲0.091
T/N	-	-	-	▲0.091
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	-	-	-	▲0.094
2W	▲0.040	▲0.023	▲0.037	▲0.097
3W	-	-	▲0.028	▲0.101
1M	-	-	-	▲0.104
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.114
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26日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	21:30 (米)新規失業保険申請件数 [前週分]	-
-	-	21:30 (米)4-6月期国内総生産 (GDP) 改定値[前期比年率]	6.6%
-	-	-	-

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▲0.030%の合出から始まり、その後は主に▲0.065%~▲0.025%の水準で合出が見られた。全体のレート目線に大きな変化は見られず、同加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの▲0.037%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.065 ~ ▲0.060	▲0.045 ~ ▲0.045	▲0.055 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

調運動向に大きな変化はなく、堅調な地合いが継続すると予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	8月25日	8月26日	8月26日	8月27日	8月27日
券	▲300	▲1,100	▲1,100	▲1,000	▲1,000
財政	▲37,400	+4,000	+4,000	▲23,000	▲23,000
過不足	▲37,700	+2,900	+2,900	▲24,000	▲24,000
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				+9,400	
CP等買入	▲900		▲100		
国債補完供給	+100				
新型コロナ対応金融支援特別			▲178,800	+195,800	
当座預金増減	▲38,500	+29,200	+29,200	▲24,000	▲24,000
当座預金残高	5,346,100	5,375,300	5,375,300	5,351,300	5,351,300
準備預金残高	4,652,200				
積み終了先	4,651,900				
超過準備	4,651,900				
非準備預金先高	693,900				
準備預金進捗率	99.9%				
平均	32.3%				
乖離率	67.6%				

8月25日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(8/26~)						
1~3年	4,500	14,492	4,503	0.002	0.003	14.2
5~10年	4,250	11,328	4,258	0.001	0.002	28.2
25年~	500	1,438	504	▲0.001	0.000	87.6
国債補完供給(8/25~8/26)						
	23	23	▲0.350	▲0.350		
	0	0				
新型コロナ対応金融支援特別(8/25~8/26)						
	195,841	195,841				

マナターベース	所要
8月24日時点	6,603,100
今積期の所要準備額	3,739,200
8月26日以降の残り所要	
積数	2,900
平均	100

国庫短期証券入札予定

8月27日	3ヶ月	第1019回
9月3日	3ヶ月	
9月9日	6ヶ月	
9月10日	3ヶ月	
8月26日	20年	
8月31日	2年	
9月2日	10年	
9月7日	30年	

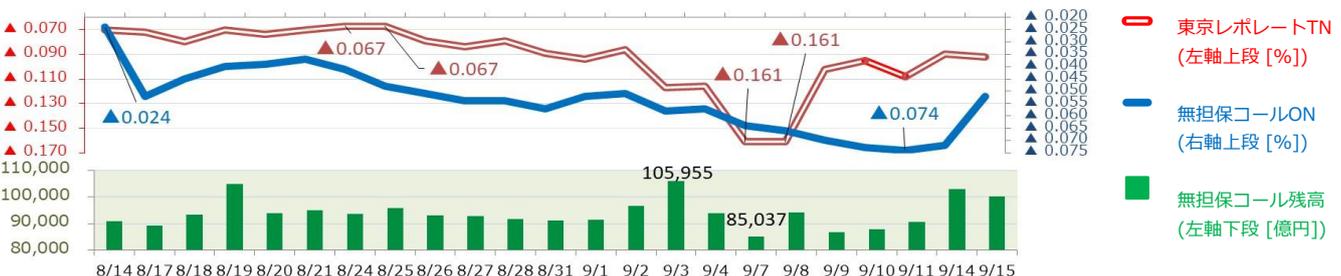
今月の国債買入オペ予定

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	1500	1,500	月1回	7月28日	-
1年超3年以下	4500	4,500	4 12 18 25	8月25日	0
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25日	1
10年超25年以下	1500	1,500	4 25	8月4日	0
25年超	500	500		8月25日	0
物価連動債	600	600	月1回	8月12日	-
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