



短期市場の推移

	8月20日	8月23日	8月24日	8月25日
加重平均金利	▲0.038	▲0.032	▲0.037	▲0.037
東京レポレート(TN)	▲0.095	▲0.095	▲0.095	▲0.091
無コール残	142,704	155,296	140,715	143,069
ON	77,131	92,683	77,492	77,466
その他	65,573	62,613	63,223	65,603
有コール残	20,393	16,558	16,564	18,194

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	▲0.070	0.001	▲0.037	▲0.089
T/N	▲0.045	▲0.028	▲0.034	▲0.087
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.038	▲0.010	▲0.033	▲0.091
2W	▲0.028	▲0.025	▲0.025	▲0.093
3W	-	-	-	▲0.096
1M	-	-	-	▲0.102
2M	-	-	0.015	-
3M	-	-	-	▲0.113
6M	-	-	-	▲0.121
1Y	-	-	-	▲0.130

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

8月27日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-	-	(米)7月個人消費支出(PCE) 価格コア指数[前年比]	3.6%
-	-	(米)FRB議長の講演	-
-	-	-	-

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%~▲0.020%の水準で合出が見られた。ビッドサイド動向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 ~ ▲0.065	- ~ -	▲0.040 ~ ▲0.020

翌営業日のマーケット

ビッドサイド動向に大きな変化はなく、出合いの水準は本日と横ばい圏を予想。

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	8月26日	8月27日	8月27日	8月30日	8月30日
券	▲1,300	▲500	▲500	+1,000	+1,000
財政	+3,400	▲12,500	▲12,500	+12,000	+12,000
過不足	+2,100	▲13,000	▲13,000	+13,000	+13,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	スタート
国庫短期証券買入				+1,000	
国債買入		+9,400			
CP等買入	▲100		▲300		
国債補充供給		▲100	+100		
新型コロナ対応金融支援特別	▲178,800	+195,800			
当座預金増減		+28,300	▲12,200	+13,000	+13,000
当座預金残高		5,374,400	5,362,200	5,375,200	5,375,200
準備預金残高		4,687,700			
積み終了先		4,687,400	国債発行(20年)		
超過準備		4,687,400			
非準備先残高		686,700			
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

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~)	1,000	9,273	1,001	0.003	0.003	48.0
CP等買入(8/31~)	5,000	8,116	4,984	▲0.015	▲0.010	30.4
国債補充供給(8/26~8/27)	118	118	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース (億円)
8月25日時点 6,564,900

所要	(億円)
今積期の所要準備額	3,739,200
8月27日以降の残り所要	
積数	2,600
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31日	2年	
9月2日	10年	
9月7日	30年	
9月9日	5年	

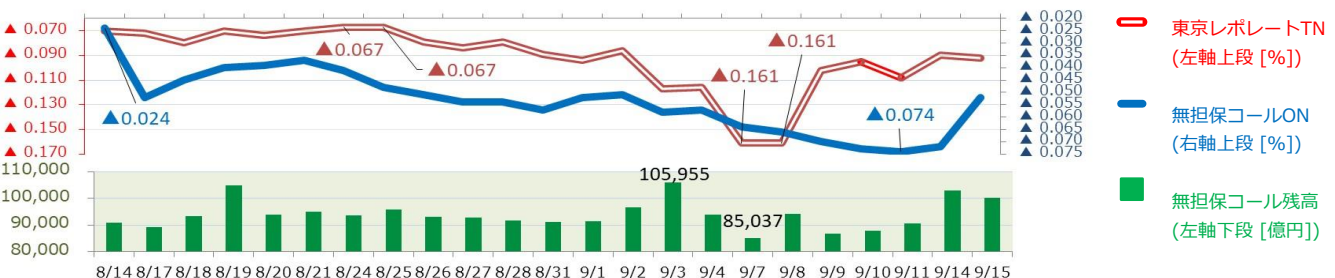
今月の国債買入オペ予定

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	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