



短期市場の推移

	8月23日	8月24日	8月25日	8月26日
加重平均金利	▲0.032	▲0.037	▲0.037	▲0.037
東京レボレート(TN)	▲0.095	▲0.095	▲0.091	▲0.087
無コール残	155,296	140,715	143,069	144,391
ON	92,683	77,492	77,466	77,643
その他	62,613	63,223	65,603	66,748
有コール残	16,558	16,564	18,194	17,753

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

本日の市況

	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	▲0.087
T/N	-	-	▲0.045	▲0.084
S/N	-	-	▲0.015	-
1W	▲0.030	0.000	▲0.023	▲0.087
2W	-	-	▲0.040	▲0.091
3W	-	-	-	▲0.094
1M	▲0.030	0.150	▲0.011	▲0.101
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

資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月27日		8月30日		8月31日	
券	▲500		▲200		+1,200	
財政	▲13,000		+18,800		+100	
過不足	▲13,500		+18,600		+1,300	
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
国庫短期証券買入	+1,000					
CP等買入	▲300		▲200		+5,000	
社債等買入			▲100			
国債補完供給	+100					
当座預金増減	▲12,700		+18,300		+6,300	
当座預金残高	5,361,700		5,380,000		5,386,300	
準備預金残高	4,694,200		主な需給要因			
積み終了先	4,693,800		国庫短期証券			
超過準備	4,693,800		発行・償還			
非準備先残高	667,500		(3M)			
準備預金進捗率	99.9%					
平均	45.2%					
乖離率	54.7%					

8月27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(8/27~8/30)

18	18	▲0.350	▲0.350
0	0		

マネタリーベース [億円]

8月26日時点 6,594,400

所要

今積期の所要準備額 3,739,200

8月30日以降の残り所要

積数 1,600

平均 100

国庫短期証券入札予定

9月3日	3ヶ月
9月9日	6ヶ月
9月10日	3ヶ月
9月16日	1年

国債入札予定

8月31日	2年
9月2日	10年
9月7日	30年
9月9日	5年

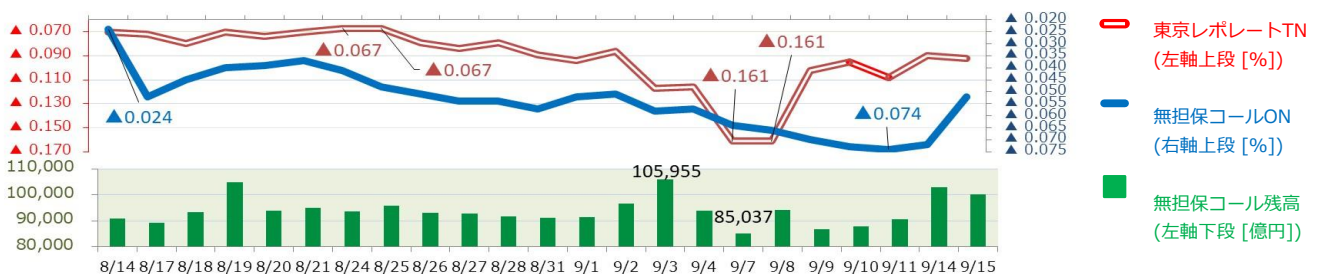
今月の国債買入オペ予定

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	8月4日	0
25年超	500	500	25	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