



短期市場の推移

	8月25日	8月26日	8月27日	8月30日
加重平均金利	▲0.037	▲0.037	▲0.037	▲0.036
東京レボレート(TN)	▲0.091	▲0.087	▲0.084	▲0.085
無コール残	143,069	144,391	147,395	132,980
ON	77,466	77,643	79,927	68,812
その他	65,603	66,748	67,468	64,168
有コール残	18,194	17,753	18,179	16,656

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	▲0.080	0.001	▲0.036	▲0.087
T/N	▲0.045	▲0.028	▲0.034	▲0.086
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	▲0.007	▲0.020	▲0.087
2W	▲0.045	▲0.035	▲0.040	▲0.088
3W	-	-	-	▲0.093
1M	▲0.040	▲0.025	▲0.033	▲0.103
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.111
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31日	9月1日	9月2日
券	+500	+200	+0
財政	+3,400	▲32,000	▲14,000
過不足	+3,900	▲31,800	▲14,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国庫短期証券買入		▲1,000	
国債買入	+10,500		
共通担保(全店)		▲3,400	+2,400
CP等買入	▲3,800	+5,000	
社債等買入	▲200		
国債補完供給	+300		
成長基盤強化支援		▲3,200	+5,000
当座預金増減	+15,700	▲30,000	▲14,000
当座預金残高	5,393,100	5,363,100	5,349,100
準備預金残高	4,717,100		
積み終了先	4,716,700		
超過準備	4,716,700		
非準備先残高	676,000		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	51.6%		
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

国庫短期証券買入(9/1~)

1,000 11,676 1,000 0.004 0.004

米ドル資金供給(9/2~9/9)

0 0 0.330 0.330

国債補完供給(8/31~9/1)

20 20 ▲0.350 ▲0.350

共通担保(全店)(9/1~9/15)

20,000 2,351 2,351

マネタリーベース [億円]

8月30日時点 6,598,300

所要

今積期の所要準備額 3,739,200

9月1日以降の残り所要

積数 900

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

9月2日	10年
9月7日	30年
9月9日	5年
9月16日	20年

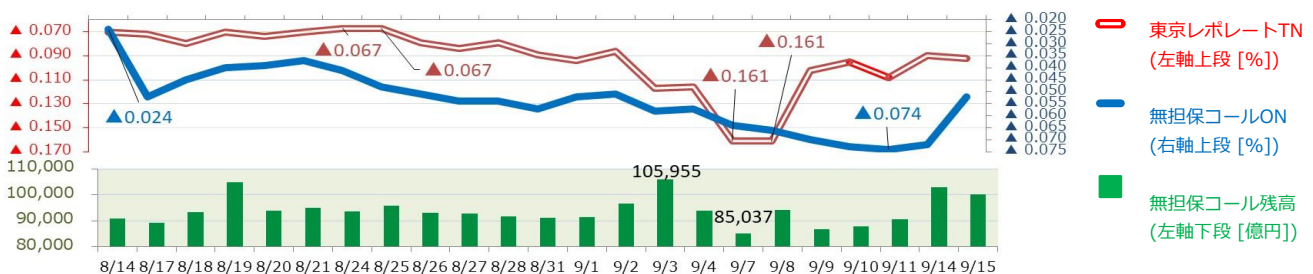
来月の国債買入オペ予定

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	1500	1,500	月1回	8月30日	1
1年超3年以下	4500	4,500	3 8 15 24	8月25日	4
3年超5年以下	4500	4,500	3 15 24 29	8月30日	4
5年超10年以下	4250	4,250	8 15 24 29	8月30日	4
10年超25年以下	1500	1,500	3	8月4日	1
25年超	500	500	24	8月25日	1
物価連動債	600	600	月1回	8月12日	1
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