



短期市場の推移

[億円] [%]

	8月31日	9月1日	9月2日	9月3日
加重平均金利	▲0.036	▲0.032	▲0.026	▲0.020
東京レポレート(TN)	▲0.086	▲0.080	▲0.075	▲0.075
無コール残	123,375	123,757	122,614	122,953
ON	61,517	61,069	60,391	60,600
その他	61,858	62,688	62,223	62,353
有コール残	18,122	18,721	18,652	18,576

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	▲0.018	▲0.070
T/N	-	-	-	▲0.070
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.040	0.001	▲0.022	▲0.077
2W	▲0.030	▲0.003	▲0.027	▲0.082
3W	-	-	▲0.004	▲0.090
1M	-	-	-	▲0.099
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.109
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

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	9月6日	9月7日	9月8日
券	+800	+900	+0
財政	+7,700	+2,300	▲14,000
過不足	+8,500	+3,200	▲14,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+10,700		
CP等買入	▲200		
社債等買入	▲100	▲200	
当座預金増減	+18,900	+3,000	▲14,000
当座預金残高	5,319,800	5,322,800	5,308,800
準備預金残高	4,684,900	主な需給要因	
積み終了先	4,684,900		
超過準備	4,684,900		
非準備先残高	634,900		
準備預金進捗率	99.9%	国債発行(30年)	
平均	71.0%		
乖離率	28.9%		

9月6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
------	------	----	----	----	----	----

社債等買入(9/9~)

1,250 2,230 1,250 ▲0.062 ▲0.051 4.2

国債補充供給(9/6~9/7)

48 48 ▲0.350 ▲0.350
0 0

マネタリーベース [億円]

9月3日時点 6,520,900

所要

今積期の所要準備額 3,739,200

9月7日以降の残り所要

積数 100

平均 0

国庫短期証券入札予定

9月9日	6ヶ月 第1021回
9月10日	3ヶ月 第1022回
9月16日	1年
9月17日	3ヶ月

国債入札予定

9月7日	30年
9月9日	5年
9月16日	20年
9月28日	40年

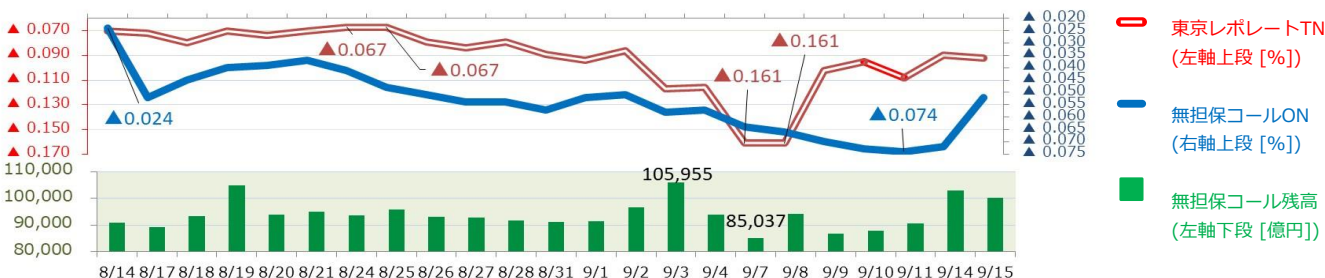
今月の国債買入オペ予定

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	8月30日	1
1年超3年以下	4500	4,500	3 8 15 24	9月3日	3
3年超5年以下	4500	4,500	3 15 24 29	9月3日	3
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 24	9月3日	0
25年超	500	500		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。投資については最終決定は、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