



短期市場の推移

[億円] [%]

	8月28日	8月31日	9月1日	9月2日
加重平均金利	0.977	0.977	0.977	0.977
東京レポレート(TN)	1.000	1.000	1.000	1.000
無コール残	102,596	99,952	103,274	103,786
ON	37,503	35,950	39,487	40,119
その他	65,093	64,002	63,787	63,667
有コール残	22,184	21,689	24,033	23,860

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重。

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	0.950	1.030	0.978	1.000
T/N	-	-	-	1.000
S/N	-	-	0.970	-
1W	0.981	1.115	1.008	1.000
2W	-	-	1.033	1.000
3W	-	-	1.070	1.005
1M	1.270	1.290	1.275	1.083
2M	-	-	1.310	-
3M	1.350	1.620	1.478	1.206
6M	-	-	-	1.285
1Y	-	-	-	1.487

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3日	9月4日	9月7日
券	+200	+700	+1,000
財政	▲2,200	▲4,100	+4,000
過不足	▲2,000	▲3,400	+5,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入	+4,700		
社債等買入	▲100	▲400	
国債補完供給	+100	▲800	+800
当座預金増減	+1,900	▲3,000	+5,000
当座預金残高	4,157,400	4,154,400	4,159,400
準備預金残高	3,838,300	主な需給要因	
積み終了先	3,838,200	国債発行(30年)	国庫短期証券発行償還
超過準備	3,838,200		(3M)
非準備先残高	319,100		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	61.3%		
乖離率	38.6%		

国庫短期証券入札予定

9月4日	3ヶ月(第1404回)
9月9日	6ヶ月(第1405回)
9月11日	3ヶ月
9月16日	1年

国債入札予定

9月8日	5年
9月15日	20年
9月29日	40年
9月30日	2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	1,000	1,000	2					9月2日	0
1年超3年以下	3,550	3,550	9	28				8月19日	2
3年超5年以下	3,200	3,200	2	16				9月2日	1
5年超10年以下	3,350	3,350	9	16				8月19日	2
10年超25年以下	1,000	1,000	2	28				9月2日	1
25年超	750	750	9	16				8月19日	2
物価連動債	300	300	28					8月27日	1
変動利付債	-	300						4月14日	-

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