



短期市場の推移

[億円] [%]

	9月1日	9月2日	9月3日	9月4日
加重平均金利	0.977	0.977	0.978	0.977
東京レポレート(TN)	1.000	1.000	1.000	1.000
無コール残	103,274	103,786	102,779	102,181
ON	39,487	40,119	38,502	38,234
その他	63,787	63,667	64,277	63,947
有コール残	24,033	23,860	23,455	23,221

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	0.978	0.977	0.999
T/N	-	-	-	1.000
S/N	-	-	0.970	-
1W	0.983	1.050	1.005	1.000
2W	1.090	1.130	1.117	1.000
3W	1.140	1.220	1.167	1.046
1M	-	-	1.300	1.113
2M	-	-	-	-
3M	-	-	1.390	1.222
6M	-	-	-	1.312
1Y	-	-	-	1.502

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7日	9月8日	9月8日	9月9日	9月9日	9月9日
券		+600		+900		+0
財政		+3,300		▲5,600		▲36,000
過不足		+3,900		▲4,700		▲36,000
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
国債補完供給	+300	▲1,200	+1,200			
社債等買入	▲100					
当座預金増減		+2,900		▲3,500		▲36,000
当座預金残高		4,161,200		4,157,700		4,121,700
準備預金残高		3,845,400				
積み終了先		3,845,400				
超過準備		3,845,400				
非準備先残高		315,800				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		74.2%				
乖離率		25.7%				

国庫短期証券入札予定

9月9日	6ヶ月(第1405回)
9月11日	3ヶ月(第1406回)
9月16日	1年
9月17日	3ヶ月

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	一回当たりオペファー金額	直近オペファー額	オペファー予定日					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