



短期市場の推移

[億円] [%]

	8月27日	8月28日	8月29日	9月1日
加重平均金利	0.478	0.478	0.477	0.477
東京レボレート(TN)	0.489	0.432	0.490	0.491
無コール残	88,303	90,615	89,643	89,688
ON	35,977	37,269	39,457	38,912
その他	52,326	53,346	50,186	50,776
有コール残	31,658	31,387	30,736	30,932

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	0.450	0.525	0.478	0.489
T/N	-	-	-	0.492
S/N	-	-	-	-
1W	0.530	0.560	0.535	0.482
2W	0.483	0.590	0.510	0.482
3W	-	-	-	0.482
1M	0.560	0.600	0.578	0.484
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	0.532
6M	-	-	-	0.568
1Y	-	-	-	0.672

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

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	9月2日	9月3日	9月3日	9月4日	9月4日	9月4日
券						
財政						
過不足						
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
共通担保(全店)						
社債等買入						
国債補完供給	+1,400	▲1,900	+1,900			
当座預金増減	▲25,500	▲29,600	▲29,600	+5,000		
当座預金残高	5,185,500	5,155,900	5,155,900	5,160,900		
準備預金残高	4,742,600	主な需給要因				
積み終了先	4,741,900					
超過準備	4,741,900					
非準備先残高	442,900					
準備預金進捗率	99.9%					
平均	58.1%					
乖離率	41.8%					

9月2日のオペ結果

オペ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

米ドル資金供給(9/4~9/11)

0 0 4.580 4.580

国債補完供給(9/2~9/3)

1,944 1,944 0.250 0.250

1 1 0.250 0.250

共通担保(全店)(9/3~9/17)

8,000 17,183 8,011 46.6

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

マネタリーベース [億円]

9月1日時点 6,430,000

所要

[億円]

今積期の所要準備額 4,108,500

9月3日以降の残り所要

積数 1,100

平均 100

国庫短期証券入札予定

9月5日	3ヶ月(第1329回)
9月9日	6ヶ月(第1330回)
9月12日	3ヶ月
9月17日	1年

国債入札予定

9月4日	30年
9月10日	5年
9月17日	20年
9月25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	1000	1,000	3				8月6日	1
1年超3年以下	3250	3,250	3	11	24		8月20日	3
3年超5年以下	3250	3,250	3	24	29		8月27日	3
5年超10年以下	3500	3,500	11	24	29		8月27日	3
10年超25年以下	1350	1,350	3	11	24		8月27日	3
25年超	750	750	11	29			8月27日	2
物価連動債	500	500	29				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