



短期市場の推移

[億円][%]

	8月28日	8月29日	9月1日	9月2日
加重平均金利	0.478	0.477	0.477	0.478
東京レボ レート(TN)	0.432	0.490	0.491	0.492
無コール残	90,615	89,643	89,688	90,247
ON	37,269	39,457	38,912	39,291
その他	53,346	50,186	50,776	50,956
有コール残	31,387	30,736	30,932	30,634

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	0.488
T/N	-	-	-	0.488
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.484	0.482
2W	0.470	0.481	0.477	0.482
3W	-	-	-	0.482
1M	-	-	-	0.484
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.600	0.531
6M	-	-	-	0.568
1Y	-	-	-	0.671

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3日	9月4日	9月4日	9月5日	9月5日
券		▲200	+200		+0
財政		▲32,100	+4,600		▲9,000
過不足		▲32,300	+4,800		▲9,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
国債買入				+8,300	
共通担保(全店)	▲8,000	+8,000			
社債等買入	▲200		▲100		
国債補充供給	+1,900	▲1,200	+1,200		
当座預金増減		▲31,800	+14,200		▲9,000
当座預金残高		5,153,700	5,167,900		5,158,900
準備預金残高		4,717,400			主な需給要因
積み終了先		4,717,100			国債発行(30年)
超過準備		4,717,000			
非準備先残高		436,300			
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	一回当たりオペ金額	直近オペ金額	オペ予定日	直近日	残り回数
1年以下	1000	1,000	3	9月3日	0
1年超3年以下	3250	3,250	3 11 24	9月3日	2
3年超5年以下	3250	3,250	3 24 29	9月3日	2
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	9月3日	2
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

9月4日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-		(米) ADP雇用統計 (8月)	
-		(米) 貿易収支(7月)	
-		(欧) 小売売上高(7月)	

本日の市況

無担保コールON物は0.477%の出合から始まり、その後も同程度で推移した。ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比横ばいの0.478%となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477

翌営業日のマーケット

出合の水準は本日対比横ばい圏を予想する。

[%][億円]※米ドル資金供給は百万\$

9月3日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(9/4~)						
~1年	1,000	2,238	1,000	0.013	0.019	69.4
1~3年	3,250	9,219	3,255	▲0.007	▲0.001	15.8
3~5年	3,250	6,367	3,253	0.001	0.004	53.9
10~25年	1,350	3,752	1,352	0.050	0.067	7.1
国債補充供給(9/3~9/4)						
	1,215	1,215	0.250	0.250		
	0	0				

マネタリーベース [億円]

9月2日時点 6,404,200

所要

[億円]

今積期の所要準備額	4,108,500
9月4日以降の残り所要	
積数	800
平均	100