



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	0.477	0.478	0.478	0.479
東京レボレート(TN)	0.491	0.492	0.488	0.485
無コール残	89,688	90,247	91,051	92,849
ON	38,912	39,291	38,335	39,633
その他	50,776	50,956	52,716	53,216
有コール残	30,932	30,634	29,982	30,529

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	0.440	0.478	0.477	0.490
T/N	-	-	-	0.491
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	-	0.482
2W	-	-	0.590	0.482
3W	0.471	0.481	0.476	0.481
1M	-	-	-	0.484
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.700	0.530
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5日		9月8日		9月9日	
券	+1,000		+400		+1,000	
財政	▲4,500		▲6,600		▲7,000	
過不足	▲3,500		▲6,200		▲6,000	
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	+1,300	▲200	+200			
当座預金増減	▲2,400		▲6,000		▲6,000	
当座預金残高	5,163,000		5,157,000		5,151,000	
準備預金残高	4,731,400		4,731,400		4,731,400	
積み終了先	4,731,300		4,731,300		4,731,300	
超過準備	4,731,300		4,731,300		4,731,300	
非準備先残高	431,600		431,600		431,600	
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%	
平均	74.2%		74.2%		74.2%	
乖離率	25.7%		25.7%		25.7%	

9月5日のオペ結果

オペ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国債補完供給(9/5~9/8)

262	262	0.250	0.250
0	0		

マネタリーベース [億円]

9月4日時点 6,384,100

所要

[億円]

今積期の所要準備額 4,113,800

9月8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1330回)
9月12日	3ヶ月(第1331回)
9月17日	1年
9月18日	3ヶ月

国債入札予定

9月10日	5年
9月17日	20年
9月25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	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