



短期市場の推移

[億円] [%]

	8月24日	8月25日	8月26日	8月27日
加重平均金利	0.977	0.977	0.978	0.977
東京レボ レート(TN)	1.000	1.000	1.000	1.000
無コール残	101,107	100,591	99,713	102,250
ON	36,303	35,502	35,284	36,441
その他	64,804	65,089	64,429	65,809
有コール残	23,481	22,335	21,980	21,788

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	0.950	0.979	0.977	1.000
T/N	-	-	-	1.000
S/N	-	-	-	-
1W	0.982	0.983	0.983	1.000
2W	-	-	-	1.000
3W	1.040	1.100	1.063	1.000
1M	-	-	1.150	1.044
2M	-	-	-	-
3M	-	-	1.410	1.180
6M	-	-	-	1.256
1Y	-	-	-	1.442

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	
	8月28日		8月31日		9月1日	
券		+300		+700		+0
財政		+6,500		+4,500		▲34,000
過不足		+6,800		+5,200		▲34,000
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	+200	▲500	+500			
国債買入		+4,100				
社債等買入	▲100		▲600			
当座預金増減		+10,500		+5,100		▲34,000
当座預金残高		4,243,700		4,248,800		4,214,800
準備預金残高		3,920,100				主な需給要因
積み終了先		3,920,000				国債発行償還(2年)
超過準備		3,920,000				
非準備先残高		323,600				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		38.7%				
乖離率		61.2%				

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
9月11日	3ヶ月
9月16日	1年

国債入札予定

9月1日	10年
9月3日	30年
9月8日	5年
9月15日	20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	5	8月5日	0
1年超3年以下	3,550	3,550	5 19	8月19日	0
3年超5年以下	3,200	3,200	13 27	8月27日	0
5年超10年以下	3,350	3,350	13 19	8月19日	0
10年超25年以下	1,000	1,000	5 27	8月27日	0
25年超	750	750	13 19	8月19日	0
物価連動債	300	300	27	8月27日	0
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