



短期市場の推移

[億円] [%]

	8月26日	8月27日	8月28日	8月31日
加重平均金利	0.978	0.977	0.977	0.977
東京レボレート(TN)	1.000	1.000	1.000	1.000
無コール残	99,713	102,250	102,596	99,952
ON	35,284	36,441	37,503	35,950
その他	64,429	65,809	65,093	64,002
有コール残	21,980	21,788	22,184	21,689

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	1.030	0.977	0.999
T/N	-	-	-	1.000
S/N	-	-	0.975	-
1W	0.981	1.060	1.014	1.000
2W	0.978	1.140	0.986	1.000
3W	-	-	1.065	1.000
1M	1.160	1.200	1.185	1.061
2M	-	-	1.300	-
3M	1.330	1.570	1.356	1.190
6M	-	-	-	1.266
1Y	-	-	-	1.456

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1日		9月2日		9月3日
券	+500		+100		+0
財政	▲54,600		▲28,000		+4,000
過不足	▲54,100		▲27,900		+4,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
共通担保			▲8,000	+8,000	
社債等買入	▲200		▲100		
国債補完供給	+400	▲300	+300		
当座預金増減	▲54,200		▲27,700		+4,000
当座預金残高	4,189,600		4,161,900		4,165,900
準備預金残高	3,860,300		3,860,200		3,860,200
積み終了先	3,860,200		3,860,200		3,860,200
超過準備	3,860,200		3,860,200		3,860,200
非準備先残高	329,300		329,300		329,300
準備預金進捗率	99.9%		99.9%		99.9%
平均	54.8%		54.8%		54.8%
乖離率	45.1%		45.1%		45.1%

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3日	30年
9月8日	5年
9月15日	20年
9月29日	40年

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオペファー金額	直近オペファー額	直近日	残り回数
1年以下	1,000	1,000	2	1
1年超3年以下	3,550	3,550	9	2
3年超5年以下	3,200	3,200	2	2
5年超10年以下	3,350	3,350	9	2
10年超25年以下	1,000	1,000	2	2
25年超	750	750	9	2
物価連動債	300	300	28	1
変動利付債	-	300	-	-

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2日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
10:30	高田日銀審議委員のあいさつ(札幌)		(米) ADP雇用統計(8月)		
	-		-		
	-		-		

本日の市況

無担保コールON物は0.977%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)は前営業対比横ばいの0.977%となった。

都銀・信託		証券	地銀	
- ~ -		0.977 ~ 0.977	0.977 ~ 0.977	

翌営業日のマーケット

出合い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1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(9/1~9/2)	329	329	0.500	0.500		
共通担保(全店)(9/2~9/16)	8,000	20,225	8,010		39.6	

マネタリーベース [億円]
8月31日時点 5,438,200

所要	所要
今積期の所要準備額	4,169,900
9月2日以降の残り所要	
積数	500
平均	0