



短期市場の推移

[億円] [%]

	9月7日	9月8日	9月9日	9月10日
加重平均金利	0.977	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	105,140	104,696	105,234	106,124
ON	40,943	39,729	39,777	40,837
その他	64,197	64,967	65,457	65,287
有コール残	24,091	23,239	23,003	23,861

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	0.978	0.977	1.000
T/N	-	-	1.030	1.000
S/N	-	-	0.975	-
1W	-	-	-	1.000
2W	1.041	1.050	1.044	1.051
3W	-	-	1.430	1.111
1M	-	-	1.380	1.158
2M	-	-	-	-
3M	-	-	1.420	1.252
6M	-	-	-	1.347
1Y	-	-	-	1.525

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11日	9月14日	9月15日
券	+600	▲200	+1,000
財政	▲10,600	+13,600	▲7,500
過不足	▲10,000	+13,400	▲6,500
金融調節	エンド	エンド	スタート
社債等買入	▲100		
国債補完供給	+600	+300	
貸出増加支援		▲34,400	
当座預金増減	▲9,800	▲20,700	▲6,500
当座預金残高	4,117,300	4,096,600	4,090,100
準備預金残高	3,805,300	主な需給要因	
積み終了先	3,805,300	国庫短期証券発行償還	国債発行償還(個人)
超過準備	3,805,300	(3M)	
非準備先残高	312,000	源泉所得税揚げ	
準備預金進捗率	100.0%		
平均	93.5%		
乖離率	6.5%		

国庫短期証券入札予定

9月16日	1年(第1407回)
9月17日	3ヶ月(第1408回)
9月25日	3ヶ月
10月2日	3ヶ月

国債入札予定

9月15日	20年
9月29日	40年
9月30日	2年
10月6日	10年

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオペアール金額	直近オペアール額	オペアール予定日	直近日	残り回数
1年以下	1,000	1,000	2	9月2日	0
1年超3年以下	3,550	3,550	9 28	9月9日	1
3年超5年以下	3,200	3,200	2 16	9月2日	1
5年超10年以下	3,350	3,350	9 16	9月9日	1
10年超25年以下	1,000	1,000	2 28	9月2日	1
25年超	750	750	9 16	9月9日	1
物価連動債	300	300	28	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