



短期市場の推移

	8月27日	8月28日	8月29日	8月30日
加重平均金利	0.227	0.227	0.228	0.227
東京レボレート(TN)	0.221	0.196	0.058	0.230
無コール残	77,326	76,575	79,880	81,634
ON	35,649	33,708	36,523	39,047
その他	41,677	42,867	43,357	42,587
有コール残	38,178	38,455	37,548	37,018

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	0.215	0.228	0.227	0.244
T/N	-	-	-	0.233
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.227	0.187
2W	-	-	-	0.187
3W	-	-	-	0.186
1M	-	-	-	0.184
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.350	0.201
6M	-	-	-	0.253
1Y	-	-	-	0.318

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

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想
	9月2日	9月3日	9月3日	9月4日	9月4日
券		+600		+700	+0
財政		▲22,100		▲24,300	▲48,000
過不足		▲21,500		▲23,600	▲48,000
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(全店)					▲8,000
CP等買入			▲100		
社債等買入	▲300		▲200		
国債補充供給	+16,000	▲15,200	+15,200		
成長基盤強化支援	▲1,500				
当座預金増減		▲22,500		▲8,700	▲56,000
当座預金残高		5,481,900		5,473,200	5,417,200
準備預金残高		4,902,900			主な需給要因
積み終了先		4,902,800			消費税・法人税
超過準備		4,902,800			・保険揚げ
非準備先残高		579,000			普通交付税交付金
準備預金進捗率		99.9%			国債発行(10年)
平均		58.1%			
乖離率		41.8%			

9月2日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債補充供給(9/2~9/3)	15,468	15,468	▲0.050	▲0.050		
	0	0				

マネタリーベース	所要
8月30日時点	6,748,700
今積期の所要準備額	4,070,500
9月3日以降の残り所要	
積数	700
平均	100

国庫短期証券入札予定

9月6日	3ヶ月(第1254回)
9月9日	6ヶ月(第1255回)
9月13日	3ヶ月
9月18日	1年
9月3日	10年
9月5日	30年
9月10日	5年
9月12日	20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	1500	1,500	4	8月2日	1
1年超3年以下	3500	3,500	4 11 18 25	8月21日	4
3年超5年以下	3750	3,750	4 11 18 25	8月28日	4
5年超10年以下	4000	4,000	6 11 18 25	8月28日	4
10年超25年以下	1500	1,500	6 18 25	8月28日	3
25年超	750	750	6 11	8月28日	2
物価連動債	600	600	25	8月28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