



短期市場の推移

[億円][%]

	9月3日	9月4日	9月5日	9月8日
加重平均金利	0.478	0.479	0.477	0.477
東京レボ レート(TN)	0.488	0.485	0.491	0.490
無コール残	91,051	92,849	87,342	87,252
ON	38,335	39,633	35,476	34,786
その他	52,716	53,216	51,866	52,466
有コール残	29,982	30,529	30,349	30,828

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	0.440	0.525	0.477	0.486
T/N	-	-	-	0.489
S/N	-	-	-	-
1W	0.485	0.550	0.518	0.482
2W	0.470	0.481	0.476	0.482
3W	-	-	-	0.481
1M	-	-	-	0.485
2M	-	-	0.590	-
3M	-	-	-	0.526
6M	-	-	-	0.568
1Y	-	-	-	0.669

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9日	9月10日	9月10日	9月11日	9月11日	9月11日
券		+700		+400		+0
財政		▲6,700		▲10,400		▲30,000
過不足		▲6,000		▲10,000		▲30,000
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
社債等買入	▲200		▲100			
国債補充供給	+700	▲1,500	+1,500			
当座預金増減		▲7,000		▲8,600		▲30,000
当座預金残高		5,152,600		5,144,000		5,114,000
準備預金残高		4,717,100				主な需給要因
積み終了先		4,717,100				国庫短期証券発行償還
超過準備		4,717,100				(6M)
非準備先残高		435,500				国債発行(5年)
準備預金進捗率		100.0%				
平均		80.6%				
乖離率		19.4%				

国庫短期証券入札予定

9月12日	3ヶ月(第1331回)
9月17日	1年
9月18日	3ヶ月
9月26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	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 -

9月10日の予定(時刻は日本時間)

日本		予想	海外		予想
	-			(米) PPI (8月)	
	-			-	
	-			-	

本日の市況

無担保コールON物は0.477%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)は前営業日横ばいの0.477%となった。

[%]

都銀・信託	証券	地銀
- ~ -	0.477 ~ 0.477	0.477 ~ 0.477

翌営業日のマーケット

出合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9日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
------	------	----	----	----	----	----

米ドル資金供給(9/11~9/18)

2 2 4.580 4.580

国債補充供給(9/9~9/10)

1,628 1,628 0.250 0.250

0 0

米ドル資金供給用担保国債供給(9/10~9/19)

5,000 4 4 0.470 0.470

マネタリーベース [億円]

9月8日時点 6,376,900

所要

[億円]

今積期の所要準備額 4,113,800

9月10日以降の残り所要

積数 0

平均 0

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