



短期市場の推移

[億円] [%]

	9月4日	9月5日	9月8日	9月9日
加重平均金利	0.479	0.477	0.477	0.477
東京レボ レート(TN)	0.485	0.491	0.490	0.489
無コール残	92,849	87,342	87,252	86,791
ON	39,633	35,476	34,786	34,375
その他	53,216	51,866	52,466	52,416
有コール残	30,529	30,349	30,828	30,536

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、無担保コール残高は無担保・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	0.450	0.525	0.477	0.489
T/N	-	-	-	0.491
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	0.484	0.482
2W	-	-	0.475	0.482
3W	-	-	-	0.481
1M	-	-	0.550	0.484
2M	-	-	-	-
3M	0.600	0.630	0.620	0.525
6M	-	-	-	0.569
1Y	-	-	-	0.670

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10日	9月11日	9月11日	9月12日	9月12日	9月12日
券						+400
財政						▲100
過不足						▲7,000
金融調節	▲16,600	▲16,200	▲25,200	▲25,200	▲7,000	▲7,000
社債等買入	▲100	▲100	▲100	▲100	▲100	▲100
国債補完供給	+1,500	▲2,700	+2,700			
貸出増加支援						▲149,100
						+10,700
当座預金増減	▲17,500	▲22,500	▲22,500	▲22,500	▲145,400	▲145,400
当座預金残高	5,135,100	5,112,600	5,112,600	5,112,600	4,967,200	4,967,200
準備預金残高	4,695,600	4,695,500	4,695,500	4,695,500	4,695,500	4,695,500
積み終了先						
超過準備	4,695,500	4,695,500	4,695,500	4,695,500	4,695,500	4,695,500
非準備先残高	439,500	439,500	439,500	439,500	439,500	439,500
準備預金進捗率	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%	100.0%
平均	83.9%	83.9%	83.9%	83.9%	83.9%	83.9%
乖離率	16.1%	16.1%	16.1%	16.1%	16.1%	16.1%

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(第1332回)
9月18日	3ヶ月
9月26日	3ヶ月

国債入札予定

9月17日	20年
9月25日	40年
9月30日	2年
10月2日	10年

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオペ金額	直近オペ額	オペ予定日	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	-

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11日の予定(時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
-		(米) CPI (8月)	
-		(欧) ラガルドECB総裁の会見	
-		-	

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10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(9/10~9/11)

2,812	2,812	0.250	0.250
100	100	0.250	0.250

マネタリーベース [億円]

9月9日時点 6,369,200

所要

今積期の所要準備額 4,113,800

9月11日以降の残り所要

積数 0

平均 0